

# 方正证券股份有限公司

## 二〇一六 年度报告

601901

公司代码：601901

公司简称：方正证券

# 方正证券股份有限公司

## 2016 年年度报告

### 重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事（除徐昂杨董事外）、监事（除马楠监事外）、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、本报告经公司第三届董事会第六次会议审议通过。出席会议的董事应到 8 名，实到 7 名，董事徐昂杨先生未出席会议。出席会议的董事一致同意本报告。

三、天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司 2016 年度财务报告进行了审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人高利、主管会计工作负责人卫剑波及会计机构负责人（会计主管人员）祖坤声明：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：

截至 2016 年 12 月 31 日，公司净稳定资金率为 117.02%，截至 2017 年 2 月末，公司净稳定资金率为 118.92%，均低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的 120%的预警标准。根据公司章程第二百三十五条的相关规定“公司可供分配利润中向股东进行现金分配的部分必须符合相关法律法规的要求，并应确保利润分配方案实施后，公司净资本等风险控制指标不低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的预警标准”。为保证公司持续稳定发展，公司拟定 2016 年度不进行现金分红，不送红股，也不进行资本公积转增股本。公司将按照《公司章程》的约定，继续实行可持续、稳定、积极的利润分配政策，并结合公司实际情况、政策导向和市场意愿，不断提高公司运营绩效，完善公司股利分配政策，增加分配政策执行的透明度，维护公司全体股东利益。此项预案须提交股东大会审议。

六、本报告内容涉及的未来计划等前瞻性陈述因存在不确定性，不构成公司对投资者的实质承诺，请投资者注意投资风险。

七、公司不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

八、公司不存在对外提供担保的情况。

九、重大风险提示。

公司已在本报告中详细披露存在的风险，敬请查阅“第四节 经营情况讨论与分析”中关于未来发展的讨论与分析中可能面对的风险因素。

十、其他 适用 不适用

## 目录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 第一节 释义 .....               | 3  |
| 第二节 公司简介和主要财务指标.....       | 4  |
| 第三节 公司业务概要.....            | 16 |
| 第四节 经营情况讨论与分析.....         | 19 |
| 第五节 重要事项.....              | 37 |
| 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.....              | 72 |
| 第十节 公司债券相关情况.....          | 81 |
| 第十一节 财务报告.....             | 84 |
| 第十二节 备查文件目录.....           | 84 |
| 第十三节 证券公司信息披露.....         | 85 |
| 附录一 分支机构名录.....            | 86 |
| 审计报告 .....                 | 99 |

## 第一节 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：

|             |   |  |
|-------------|---|--|
| 本公司、公司、方正证券 | 指 | 方正证券股份有限公司   |
| 报告期         | 指 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日   |
| 期后          | 指 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 30 日  |
| 方正集团、控股股东   | 指 | 北大方正集团有限公司   |
| 政泉控股        | 指 | 北京政泉控股有限公司   |
| 民族证券        | 指 | 中国民族证券有限责任公司   |
| 方正和生        | 指 | 方正和生投资有限责任公司   |
| 瑞信方正        | 指 | 瑞信方正证券有限责任公司   |
| 方正中期        | 指 | 方正中期期货有限公司   |
| 方正投资        | 指 | 方正证券投资有限公司   |
| 方正富邦        | 指 | 方正富邦基金管理有限公司   |
| 方正香港        | 指 | 方正证券（香港）金融控股有限公司   |
| 方正富邦创融      | 指 | 北京方正富邦创融资产管理有限公司，系方正富邦基金管理有限公司的子公司   |
| 上海际丰        | 指 | 上海际丰投资管理有限责任公司，系方正中期期货有限公司的子公司   |
| 资管分公司       | 指 | 方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司  |
| 自营分公司       | 指 | 方正证券股份有限公司北京证券自营分公司  |
| 中国证监会       | 指 | 中国证券监督管理委员会  |
| 湖南证监局       | 指 | 中国证券监督管理委员会湖南监管局   |
| 北京证监局       | 指 | 中国证券监督管理委员会北京监管局   |
| 公司法         | 指 | 中华人民共和国公司法   |
| 证券法         | 指 | 中华人民共和国证券法   |
| 公司章程        | 指 | 方正证券股份有限公司章程   |
| 火箭公司        | 指 | 航天固体运载火箭有限公司   |
| QFII        | 指 | 合格境外机构投资者  |
| IB 业务       | 指 | 为期货提供中间介绍业务  |
| 新三板         | 指 | 全国中小企业股份转让系统   |
| 元、万元、亿元     | 指 | 人民币元、人民币万元、人民币亿元   |
| 本报告、本年度报告   | 指 | 方正证券股份有限公司 2016 年年度报告  |
| 指定信息披露媒体    | 指 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站<br><a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> |

## 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   | 方正证券股份有限公司                   |
| 公司的中文简称   | 方正证券                         |
| 公司的外文名称   | Founder Securities Co., Ltd. |
| 公司的外文名称缩写 | Founder Securities           |
| 公司的法定代表人  | 高利                           |
| 公司总经理     | 何亚刚                          |

### 注册资本和净资产

|         | 本报告期末<br>(2016年12月31日) | 上年度末<br>(2015年12月31日) |
|---------|------------------------|-----------------------|
| 注册资本(元) | 8,232,101,395.00       | 8,232,101,395.00      |
| 净资产(元)  | 21,859,254,511.38      | 21,518,154,975.05     |

注：净资产根据中国证监会于2016年6月16日修订的《证券公司风险控制指标管理办法》计算，并对上年度末数据进行了追溯调整。

### 公司的各单项业务资格情况

- 1、证券经纪业务资格（除广东省深圳市前海深港现代服务业合作区之外）；
- 2、证券投资咨询资格；
- 3、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问资格；
- 4、证券自营资格；
- 5、证券资产管理业务资格；
- 6、证券投资基金代销资格；
- 7、融资融券业务资格；
- 8、直接投资业务试点资格；
- 9、全国中小企业股份转让系统业务资格；
- 10、外币有价证券经纪业务资格；
- 11、网上证券委托业务资格；
- 12、开放式证券投资基金代销业务资格；
- 13、全国银行间同业拆借市场准入资格；
- 14、新股网下询价业务资格；
- 15、为期货公司提供中间介绍业务资格；
- 16、证券经纪人制度实施资格；
- 17、上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格；
- 18、中国证券登记结算有限责任公司结算参与人资格；
- 19、债券质押式报价回购业务资格；
- 20、约定购回式证券交易业务资格；

- 21、转融通业务资格；
- 22、代销金融产品业务资格；
- 23、受托管理保险资金业务资格；
- 24、股票质押式回购业务资格；
- 25、上海证券交易所股票期权交易参与者。

公司具备上海证券交易所会员资格、深圳证券交易所会员资格及中国证券业协会会员资格。

## 二、联系人和联系方式

|      | 董事会秘书                 | 合规总监                  | 证券事务代表                |
|------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 姓名   | 熊郁柳                   | 孙斌                    | 谭剑伟                   |
| 联系地址 | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22层 | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22层 | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22层 |
| 电话   | 0731-85832367         | 0731-85832367         | 0731-85832367         |
| 传真   | 0731-85832366         | 0731-85832366         | 0731-85832366         |
| 电子信箱 | pub@foundersc.com     | pub@foundersc.com     | pub@foundersc.com     |

## 三、基本情况简介

|             |                          |
|-------------|--------------------------|
| 公司注册地址      | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 |
| 公司注册地址的邮政编码 | 410015                   |
| 公司办公地址      | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 |
| 公司办公地址的邮政编码 | 410015                   |
| 公司网址        | http://www.foundersc.com |
| 电子信箱        | pub@foundersc.com        |
| 统一社会信用代码    | 914300001429279950       |

## 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、证券日报 |
| 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          | 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22层 |

## 五、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   | 变更前股票简称 |
|------|---------|------|--------|---------|
| A股   | 上海证券交易所 | 方正证券 | 601901 | 不适用     |

## 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

公司系由方正证券有限责任公司整体变更设立，方正证券有限责任公司前身为浙江省证券公司。

1988年6月6日，经中国人民银行“银复[1988]259号”《关于同意设立浙江省证券公司的批复》批准，浙江省证券公司成立，注册资金为1,000万元，资金来源为中国人民银行拨款，注册地为浙江省杭州市。

1992年4月，经中国人民银行浙江省分行和浙江省工商局核准，浙江省证券公司注册资本由1,000万元增加至5,100万元。

1994 年 10 月 26 日，经中国人民银行“银复[1994]232 号”《关于浙江省证券公司改制的批复》和中国人民银行浙江省分行“浙银发[1994]331 号”《关于同意浙江省证券公司改制的批复》批准，浙江省证券公司按有限责任公司形式进行改造，名称变更为“浙江证券有限责任公司”，注册资本增加至 4.5 亿元。

2002 年 8 月 29 日，经中国证监会“机构部部函[2002]270 号”《关于同意北京北大方正集团公司受让浙江证券有限责任公司股权的函》同意方正集团受让浙江证券有限责任公司全体股东所持 51%的股权，依法办理了有关工商变更登记手续。

2003 年 8 月 13 日，经中国证监会“机构部部函[2003]248 号”《关于浙江证券有限责任公司更名有关材料备案的回函》同意浙江证券有限责任公司名称变更为“方正证券有限责任公司”，并完成了工商变更登记手续。

2008 年 3 月，经中国证监会“证监许可 [2008]52 号”《关于核准方正证券有限责任公司迁址的批复》批准，公司住所迁至“湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层”。

2008 年 7 月，经中国证监会“证监许可[2008]663 号”《关于核准泰阳证券有限责任公司股权变更以及方正证券有限责任公司换股吸收合并泰阳证券有限责任公司的批复》批准，方正证券有限责任公司吸收合并了泰阳证券有限责任公司，合并后的注册资本为 1,653,879,170.34 元。

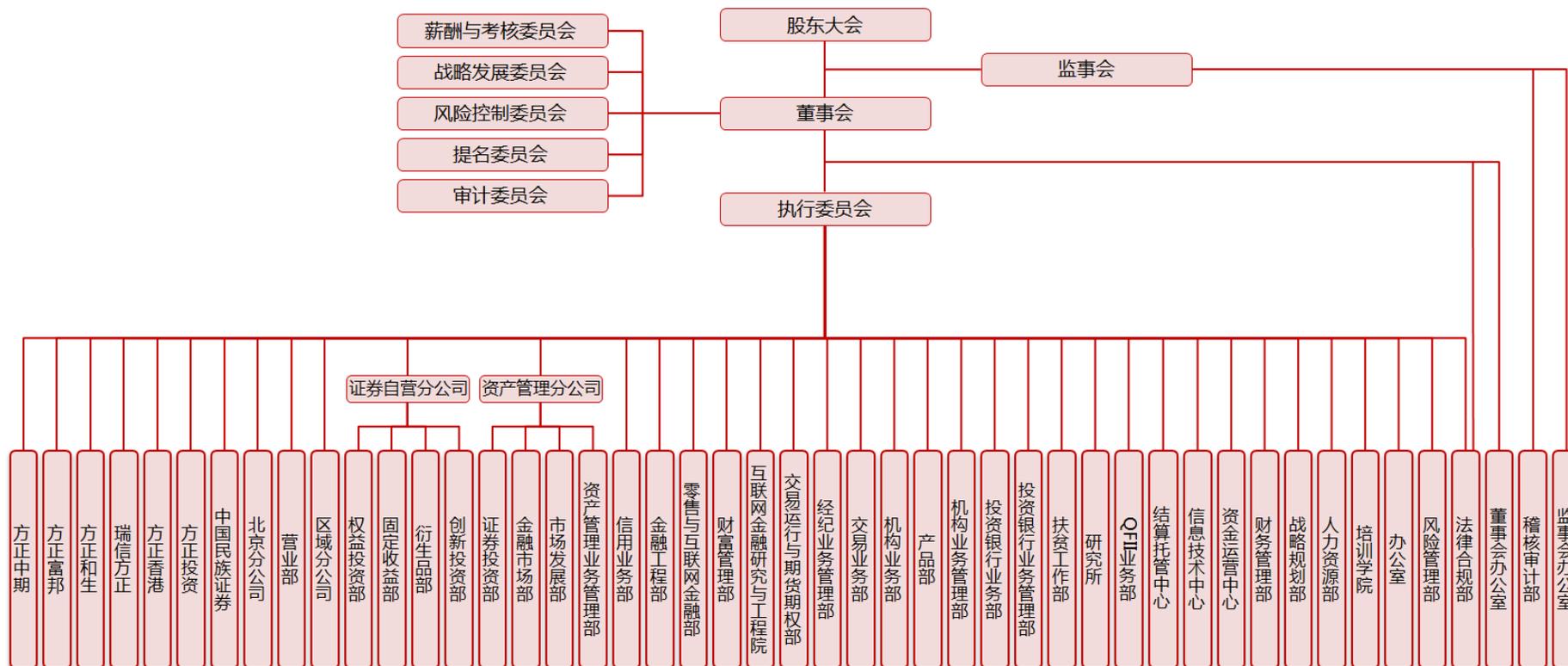
2010 年 9 月，经中国证监会“证监许可[2010]1199 号”《关于核准方正证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》批准，方正证券有限责任公司整体变更为方正证券股份有限公司，变更后的注册资本为 46 亿元。

2011 年 8 月，经中国证监会“证监许可[2011]1124 号”《关于核准方正证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》批准，公司首次公开发行人民币普通股（A 股）15 亿股，共募集资金净额 5,648,175,312.34 元，并于 2011 年 8 月 10 日在上海证券交易所上市。2012 年 2 月 14 日，公司在湖南省工商行政管理局办理了注册资本工商变更登记手续，注册资本增加至 61 亿元。

2014 年 8 月，经中国证监会“证监许可[2014]795 号”《关于核准方正证券股份有限公司向北京政泉控股有限公司等发行股份购买资产的批复》批准，公司向政泉控股等五家法人发行 2,132,101,395 股股份，购买民族证券 100%股权。2014 年 8 月 11 日，公司在湖南省工商行政管理局办理了注册资本工商变更登记手续，注册资本增加至 8,232,101,395 元。

## （二）公司组织机构情况

### 1、公司组织机构图



## 2、子公司情况

### (1) 民族证券

成立日期：2002 年 4 月 29 日

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

注册资本：44.87 亿元

公司持股比例：100%

法定代表人：何亚刚

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；融资融券；代销金融产品；保险兼业代理；为期货公司提供中间介绍业务。

### (2) 方正和生

成立日期：2010 年 8 月 5 日

注册地址：拉萨市金珠西路 158 号阳光新城区 B 区 1 栋 2 单元 5-1 号

注册资本：17 亿元

公司持股比例：100%

法定代表人：何其聪

经营范围：使用自有资金或设立直投基金，对企业进行股权投资或债权投资，或投资于与股权投资、债权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资、债权投资相关的财务顾问服务；经中国证监会认可开展的其他业务。

### (3) 瑞信方正

成立日期：2008 年 10 月 24 日

注册地址：北京市昌平区回龙观镇金燕龙大厦 19 层 1903、1905 号

注册资本：8 亿元

公司持股比例：66.7%

法定代表人：高利

经营范围：股票（包括人民币普通股、外资股）和债券（包括政府债券、公司债券）的承销与保荐；证券经纪业务（限前海地区）；中国证监会批准的其他业务。

### (4) 方正中期

成立日期：2005 年 8 月 9 日

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号楼泰康金融大厦 22 层 2201

注册资本：3.4 亿元

公司持股比例：90.62%

法定代表人：姜志军

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。

(5) 方正投资

成立日期：2014 年 8 月 7 日  
 注册地址：北京市怀柔区雁栖经济开发区杨雁路 88 号  
 注册资本：3 亿元  
 公司持股比例：100%  
 法定代表人：何其聪  
 经营范围：项目投资、投资管理、投资咨询。

(6) 方正富邦

成立日期：2011 年 7 月 8 日  
 注册地址：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层  
 注册资本：4 亿元  
 公司持股比例：66.7%  
 法定代表人：何其聪  
 经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

(7) 方正香港

成立日期：2012 年 3 月 21 日  
 注册地址：香港中环康乐广场 1 号怡和大厦 17 楼 1713-19 室  
 注册资本：1 亿元港币  
 公司持股比例：100%

3、区域分公司及证券营业部

截至 2016 年 12 月 31 日，母公司共有 10 家区域分公司（未含自营分公司及资管分公司）和 244 家证券营业部；全资子公司民族证券共有 51 家证券营业部；瑞信方正共有 1 家证券营业部。详情请参见本报告“附录一、分支机构名录”。

七、其他相关资料

|                 |         |                  |
|-----------------|---------|------------------|
| 公司聘请的会计师事务所(境内) | 名称      | 天健会计师事务所（特殊普通合伙） |
|                 | 办公地址    | 浙江省杭州市西溪路 128 号  |
|                 | 签字会计师姓名 | 魏五军、张恩学          |

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

| 项目            | 2016年            | 2015年             | 本期比上年<br>同期增减(%) | 2014年            |
|---------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|
| 营业收入          | 7,759,896,839.14 | 10,914,989,706.62 | -28.91           | 4,899,699,230.06 |
| 营业利润          | 3,150,625,706.65 | 5,520,799,659.60  | -42.93           | 2,295,851,246.82 |
| 利润总额          | 3,162,119,415.90 | 5,447,464,405.31  | -41.95           | 2,300,085,121.41 |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 2,569,336,882.57 | 4,064,211,991.64  | -36.78           | 1,796,097,769.62 |

|                        |                    |                    |                       |                   |
|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|-------------------|
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 2,564,603,742.63   | 4,102,914,475.66   | -37.49                | 1,794,748,648.12  |
| 经营活动产生的现金流量净额          | -24,854,722,475.32 | -14,504,840,945.25 | 不适用                   | 13,421,007,072.41 |
| 其他综合收益的税后净额            | -1,360,634,124.38  | 769,834,810.34     | -276.74               | 342,879,046.87    |
|                        | <b>2016年末</b>      | <b>2015年末</b>      | <b>本期末比上年同期末增减(%)</b> | <b>2014年末</b>     |
| 资产总额                   | 152,338,730,246.04 | 154,425,206,383.05 | -1.35                 | 86,923,857,305.14 |
| 负债总额                   | 116,141,885,796.65 | 118,900,482,963.43 | -2.32                 | 56,119,289,943.98 |
| 归属于上市公司股东的所有者权益        | 35,429,196,381.73  | 34,958,090,717.59  | 1.35                  | 30,335,427,644.79 |
| 所有者权益总额                | 36,196,844,449.39  | 35,524,723,419.62  | 1.89                  | 30,804,567,361.16 |
| 总股本                    | 8,232,101,395.00   | 8,232,101,395.00   | -                     | 8,232,101,395.00  |

## (二) 主要财务指标

单位：元 币种：人民币

| 项目                      | 2016年  | 2015年  | 本期比上年同期增减(%)   | 2014年  |
|-------------------------|--------|--------|----------------|--------|
| 基本每股收益(元/股)             | 0.31   | 0.49   | -36.73         | 0.26   |
| 稀释每股收益(元/股)             | 0.31   | 0.49   | -36.73         | 0.26   |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)   | 0.31   | 0.50   | -38.00         | 0.26   |
| 加权平均净资产收益率(%)           | 7.31   | 12.41  | 减少5.10个百分点     | 8.65   |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%) | 7.30   | 12.53  | 减少5.23个百分点     | 8.64   |
| 每股经营活动产生的现金流量净额(元/股)    | -3.02  | -1.76  | 不适用            | 1.63   |
| 项目                      | 2016年末 | 2015年末 | 本期末比上年同期末增减(%) | 2014年末 |
| 归属于上市公司股东的每股净资产(元/股)    | 4.30   | 4.25   | 1.18           | 3.69   |
| 资产负债率(%)                | 70.21  | 66.86  | 增加3.35个百分点     | 53.95  |

注：计算资产负债率时不包括经纪业务客户交易结算资金。

## (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                  | 21,859,254,511.38 | 21,518,154,975.05 |
| 净资产                  | 34,806,331,252.79 | 33,847,452,590.42 |
| 风险覆盖率(%)             | 180.91            | 350.45            |
| 资本杠杆率(%)             | 15.06             | 16.13             |
| 流动性覆盖率(%)            | 319.77            | 672.22            |
| 净稳定资金率(%)            | 117.02            | 150.96            |
| 净资本/净资产(%)           | 62.80             | 63.57             |
| 净资本/负债(%)            | 35.71             | 39.36             |
| 净资产/负债(%)            | 56.86             | 61.91             |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本(%)  | 34.27             | 33.71             |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%) | 164.30            | 121.25            |

注：上述数据根据中国证监会于2016年6月16日修订的《证券公司风险控制指标管理办法》计算，并对上年度末数据进行了追溯调整。

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

1、合并财务报表主要项目会计数据

单位:元 币种:人民币

| 项目                     | 2016 年末            | 2015 年末            | 增减幅度     |
|------------------------|--------------------|--------------------|----------|
| 货币资金                   | 31,653,009,147.22  | 47,771,925,975.36  | -33.74%  |
| 结算备付金                  | 10,401,675,865.84  | 15,255,694,188.31  | -31.82%  |
| 融出资金                   | 23,081,267,881.82  | 31,398,074,850.11  | -26.49%  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 35,133,307,565.31  | 25,019,830,145.82  | 40.42%   |
| 买入返售金融资产               | 12,215,615,748.75  | 5,534,275,243.41   | 120.73%  |
| 应收款项                   | 1,253,956,700.86   | 375,289,398.50     | 234.13%  |
| 应收利息                   | 1,447,446,362.79   | 1,468,800,916.99   | -1.45%   |
| 存出保证金                  | 2,431,316,817.44   | 2,478,209,392.27   | -1.89%   |
| 可供出售金融资产               | 26,483,424,940.30  | 16,160,875,630.78  | 63.87%   |
| 持有至到期投资                | 807,508,824.56     | 1,506,828,351.55   | -46.41%  |
| 递延所得税资产                | 402,195,391.12     | 170,817,003.17     | 135.45%  |
| 其他资产                   | 1,609,294,636.61   | 1,766,052,835.26   | -8.88%   |
| 资产总计                   | 152,338,730,246.04 | 154,425,206,383.05 | -1.35%   |
| 应付短期融资款                | 11,039,500,000.00  | 5,528,760,000.00   | 99.67%   |
| 拆入资金                   |                    | 552,000,000.00     | -100.00% |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 10,109,468,691.68  | 1,668,996,284.93   | 505.72%  |
| 卖出回购金融资产款              | 19,460,037,358.39  | 21,605,429,026.55  | -9.93%   |
| 代理买卖证券款                | 30,832,708,036.73  | 47,238,807,439.34  | -34.73%  |
| 应付职工薪酬                 | 1,142,427,749.57   | 1,925,286,089.82   | -40.66%  |
| 应交税费                   | 195,977,926.95     | 317,341,725.37     | -38.24%  |
| 应付款项                   | 7,357,311,486.55   | 5,320,149,484.08   | 38.29%   |
| 应付利息                   | 1,488,474,836.34   | 1,858,397,898.23   | -19.91%  |
| 应付债券                   | 33,500,000,000.00  | 31,961,060,000.00  | 4.82%    |
| 递延所得税负债                | 7,858,734.95       | 162,413,654.18     | -95.16%  |
| 其他负债                   | 701,966,337.02     | 436,292,980.92     | 60.89%   |
| 负债合计                   | 116,141,885,796.65 | 118,900,482,963.43 | -2.32%   |
| 其他综合收益                 | -298,083,561.50    | 1,059,258,531.38   | -128.14% |
| 盈余公积                   | 1,114,985,003.34   | 909,954,123.09     | 22.53%   |

|                           |                   |                   |          |
|---------------------------|-------------------|-------------------|----------|
| 一般风险准备                    | 2,954,702,136.56  | 2,451,493,899.58  | 20.53%   |
| 未分配利润                     | 6,999,462,461.90  | 5,879,253,822.11  | 19.05%   |
| 归属于母公司所有者权益<br>(或股东权益) 合计 | 35,429,196,381.73 | 34,958,090,717.59 | 1.35%    |
| 所有者权益<br>(或股东权益) 合计       | 36,196,844,449.39 | 35,524,723,419.62 | 1.89%    |
| 项 目                       | 2016 年度           | 2015 年度           | 增减幅度     |
| 营业收入                      | 7,759,896,839.14  | 10,914,989,706.62 | -28.91%  |
| 手续费及佣金净收入                 | 4,551,146,729.83  | 7,515,649,593.57  | -39.44%  |
| 其中：经纪业务手续费净收入             | 3,662,159,567.10  | 6,899,959,235.17  | -46.92%  |
| 投资银行业务手续费净收入              | 581,827,025.98    | 363,900,109.81    | 59.89%   |
| 资产管理业务手续费净收入              | 171,463,261.04    | 99,826,691.71     | 71.76%   |
| 利息净收入                     | 81,725,773.39     | 806,812,027.93    | -89.87%  |
| 投资收益（损失以“-”号填列）           | 3,587,046,962.46  | 2,296,667,532.76  | 56.18%   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益        | -31,113,475.95    | -3,251,218.02     | 不适用      |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）       | -499,509,770.07   | 224,787,917.57    | -322.21% |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）           | 2,620,958.21      | 1,850,758.19      | 41.62%   |
| 其他业务收入                    | 36,866,185.32     | 69,221,876.60     | -46.74%  |
| 营业支出                      | 4,609,271,132.49  | 5,394,190,047.02  | -14.55%  |
| 税金及附加                     | 198,577,629.08    | 668,243,039.97    | -70.28%  |
| 业务及管理费                    | 4,356,764,268.87  | 4,232,502,516.02  | 2.94%    |
| 资产减值损失                    | 48,744,056.07     | 456,913,349.43    | -89.33%  |
| 其他业务成本                    | 5,185,178.47      | 36,531,141.60     | -85.81%  |
| 营业利润                      | 3,150,625,706.65  | 5,520,799,659.60  | -42.93%  |
| 营业外收入                     | 65,811,674.56     | 41,186,187.45     | 59.79%   |
| 营业外支出                     | 54,317,965.31     | 114,521,441.74    | -52.57%  |
| 利润总额                      | 3,162,119,415.90  | 5,447,464,405.31  | -41.95%  |
| 所得税费用                     | 579,797,104.99    | 1,348,970,822.74  | -57.02%  |
| 净利润                       | 2,582,322,310.91  | 4,098,493,582.57  | -36.99%  |
| 其他综合收益的税后净额               | -1,360,634,124.38 | 769,834,810.34    | -276.74% |
| 综合收益总额                    | 1,221,688,186.53  | 4,868,328,392.91  | -74.91%  |

2、母公司财务报表主要项目会计数据

单位:元 币种:人民币

| 项目                     | 2016 年末            | 2015 年末            | 增减幅度     |
|------------------------|--------------------|--------------------|----------|
| 货币资金                   | 19,354,200,395.87  | 28,953,127,306.81  | -33.15%  |
| 结算备付金                  | 7,063,588,460.36   | 12,388,757,080.81  | -42.98%  |
| 融出资金                   | 17,252,900,873.93  | 23,746,053,363.76  | -27.34%  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 20,304,389,459.12  | 19,107,760,937.56  | 6.26%    |
| 买入返售金融资产               | 9,821,585,312.06   | 3,650,061,824.41   | 169.08%  |
| 应收款项                   | 770,663,773.58     | 176,338,790.26     | 337.04%  |
| 应收利息                   | 947,783,482.47     | 1,100,773,432.21   | -13.90%  |
| 存出保证金                  | 188,486,354.05     | 351,624,447.93     | -46.40%  |
| 可供出售金融资产               | 23,205,319,212.87  | 13,681,622,428.80  | 69.61%   |
| 持有至到期投资                | 807,508,824.56     | 1,506,828,351.55   | -46.41%  |
| 长期股权投资                 | 16,536,081,013.48  | 16,402,681,013.48  | 0.81%    |
| 投资性房地产                 | 91,561,882.00      | 141,167,780.00     | -35.14%  |
| 递延所得税资产                | 240,508,717.94     | 28,973,727.48      | 730.09%  |
| 其他资产                   | 1,248,447,958.26   | 112,827,377.04     | 1006.51% |
| 资产总计                   | 118,245,688,394.13 | 121,673,117,757.54 | -2.82%   |
| 应付短期融资款                | 11,039,500,000.00  | 3,876,270,000.00   | 184.80%  |
| 卖出回购金融资产款              | 16,625,225,835.61  | 19,250,060,453.55  | -13.64%  |
| 代理买卖证券款                | 22,225,353,111.32  | 33,156,273,692.88  | -32.97%  |
| 应付职工薪酬                 | 719,814,670.72     | 1,160,801,838.78   | -37.99%  |
| 应交税费                   | 85,128,689.37      | 225,731,120.02     | -62.29%  |
| 应付款项                   | 285,938,152.88     | 81,865,913.32      | 249.28%  |
| 应付利息                   | 1,308,731,557.24   | 1,426,416,035.66   | -8.25%   |
| 应付债券                   | 30,500,000,000.00  | 28,078,440,000.00  | 8.62%    |
| 其他负债                   | 343,510,485.73     | 244,257,732.90     | 40.63%   |
| 负债合计                   | 83,439,357,141.34  | 87,825,665,167.12  | -4.99%   |
| 其他综合收益                 | -300,200,603.50    | 50,340,411.06      | -696.34% |
| 盈余公积                   | 1,114,218,789.43   | 909,187,909.18     | 22.55%   |
| 一般风险准备                 | 2,712,426,763.29   | 2,302,365,002.79   | 17.81%   |

|                     |                  |                  |             |
|---------------------|------------------|------------------|-------------|
| 未分配利润               | 6,405,942,400.29 | 5,711,615,364.11 | 12.16%      |
| <b>项 目</b>          | <b>2016 年度</b>   | <b>2015 年度</b>   | <b>增减幅度</b> |
| 营业收入                | 5,136,351,951.36 | 9,177,335,054.17 | -44.03%     |
| 手续费及佣金净收入           | 3,019,171,998.99 | 6,489,974,003.32 | -53.48%     |
| 其中：经纪业务手续费净收入       | 2,661,395,910.29 | 6,206,084,852.94 | -57.12%     |
| 投资银行业务手续费净收入        | 192,048,630.89   | 129,485,408.06   | 48.32%      |
| 资产管理业务手续费净收入        | 152,691,275.45   | 78,743,043.86    | 93.91%      |
| 利息净收入               | -413,524,470.19  | 564,633,837.25   | -173.24%    |
| 投资收益（损失以“-”号填列）     | 2,840,218,729.71 | 1,908,924,843.35 | 48.79%      |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -328,058,543.85  | 192,398,614.11   | -270.51%    |
| 营业支出                | 2,792,565,193.67 | 3,620,127,263.32 | -22.86%     |
| 税金及附加               | 145,354,504.27   | 592,390,799.43   | -75.46%     |
| 业务及管理费              | 2,632,567,511.72 | 3,010,571,421.51 | -12.56%     |
| 资产减值损失              | 14,136,679.02    | 16,323,384.11    | -13.40%     |
| 营业利润（亏损总额以“-”号填列）   | 2,343,786,757.69 | 5,557,207,790.85 | -57.82%     |
| 营业外收入               | 49,642,340.96    | 36,753,182.36    | 35.07%      |
| 营业外支出               | 51,397,113.92    | 114,053,297.21   | -54.94%     |
| 利润总额                | 2,342,031,984.73 | 5,479,907,676.00 | -57.26%     |
| 所得税费用               | 291,723,182.25   | 1,359,338,434.63 | -78.54%     |
| 净利润                 | 2,050,308,802.48 | 4,120,569,241.37 | -50.24%     |
| 其他综合收益的税后净额         | -350,541,014.56  | -250,450,747.31  | 39.96%      |
| 综合收益总额              | 1,699,767,787.92 | 3,870,118,494.06 | -56.08%     |

### 九、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

### 十、2016 年分季度主要财务数据

单位：元 币种：人民币

| 项目                      | 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                    | 1,924,948,432.15   | 2,562,673,840.88 | 1,749,439,835.76   | 1,522,834,730.35   |
| 归属于上市公司股东的净利润           | 847,686,647.77     | 1,304,563,438.20 | 512,997,060.02     | -95,910,263.42     |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润 | 846,666,442.50     | 1,302,768,716.26 | 506,210,908.93     | -91,042,325.06     |
| 经营活动产生的现金流量净额           | -12,766,751,587.39 | 7,972,764,256.22 | -13,411,282,150.30 | -6,649,452,993.85  |

### 十一、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

| 非经常性损益项目   | 2016 年金额       | 2015 年金额        | 2014 年金额      |
|--|----------------|-----------------|---------------|
| 非流动资产处置损益  | -2,803,737.82  | 6,388,716.45    | 2,114,112.60  |
| 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 | 56,963,487.40  | 28,234,904.27   | 7,287,114.32  |
| 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                           | -5,359,332.14  | 30,796,429.81   | -1,932,490.00 |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出   | -42,666,040.33 | -107,958,875.01 | -5,167,352.33 |
| 少数股东权益影响额  | -332,974.02    | -238,747.97     | -372,969.98   |
| 所得税影响额   | -1,068,263.15  | 4,075,088.43    | -579,293.11   |
| 合计   | 4,733,139.94   | -38,702,484.02  | 1,349,121.50  |

### 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 | 25,019,830,145.82 | 35,133,307,565.31 | 10,113,477,419.49 | 1,146,494,208.72 |
| 可供出售金融资产               | 13,309,720,699.42 | 22,973,903,657.86 | 9,664,182,958.44  | 1,970,042,863.10 |
| 衍生金融工具                 | 28,156,156.73     | -82,029.48        | -28,238,186.21    | 2,515,199.48     |
| 投资性房地产                 | 275,719,048.18    | 220,423,285.04    | -55,295,763.14    | -5,359,332.14    |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 1,668,996,284.93  | 10,109,468,691.68 | 8,440,472,406.75  | -174,274,538.02  |
| 合计                     | 40,302,422,335.08 | 68,437,021,170.41 | 28,134,598,835.33 | 2,939,418,401.14 |

注：对当年利润的影响金额包括：1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、投资性房地产和衍生金融工具公允价值变动损益；2、持有和处置这些项目取得的投资收益；3、可供出售金融资产减值损失

### 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）公司所从事的主要业务及经营模式

本公司的主要业务为提供证券经纪、资产管理、投资银行等综合金融服务并从事自营投资与交易，包括：证券经纪、期货经纪、投资银行、证券自营、资产管理、研究咨询、IB 业务、QFII 业务、融资融券、直投业务、证券投资基金业务、场外市场业务、质押式报价回购业务、代销金融产品业务、受托管理保险资金业务、私募基金托管业务、新三板做市业务、收益凭证业务、私募客户资产托管业务、互联网证券业务试点等。

配合业务发展需要，公司设立了辐射全国的财富管理中心和电子商务平台、电话理财中心，重要渠道已覆盖国内大型投资基金、金融机构、知名企业投资者和海外大型 QFII 等。截至 2016 年 12 月 31 日，公司拥有区域分公司 10 家，证券营业部 296 家，期货营业部 30 家，分布在全国 28 个省（市、自治区）的重要中心城市。

报告期内，本公司业务经营情况请参见本年度报告“第四节 经营情况讨论与分析”。

##### （二）公司所属行业情况说明

我国证券业经过二十多年时间取得了长足发展，但与发达国家的成熟资本市场相比，我国证券行业规模占我国总体经济和金融行业的比重仍然偏低，未来仍具有广阔的发展空间。我国证券业盈利模式仍以经纪业务、自营业务和承销业务等传统业务为主，行业收入和利润对于市场变化趋势依赖程度较高。

2016 年受宏观经济的波动、股票市场的低迷和交易佣金率的下降等因素的影响，证券行业资产规模、营业收入、净利润均有不同程度下滑。根据中国证券业协会公布的未经审计的 2016 年度证券公司经营数据，全行业总资产规模达 5.79 万亿元，比 2015 年底减少 9.81%；全行业实现营业收入 3,279.94 亿元，同比下降 42.97%，其中代理买卖证券业务净收入 1,052.95 亿元，同比下降 60.87%；证券行业全年累计实现净利润 1,234.45 亿元，同比下降 49.57%。

#### 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

2016 年末，公司资产总额为 1,523.39 亿元，较上年末减少 1.35%。其中货币资金和结算备付金分别为 316.53 亿元和 104.02 亿元，分别较上年末减少 33.74%和 31.82%，主要系 2016 年证券市场交易量下降，客户资金减少所致；融出资金为 230.81 亿元，较上年末减少 26.49%，主要系 2016 年市场两融规模减少所致；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为 351.33 亿元，较上年末增加 40.42%，主要系公司增加了债券、基金投资规模所致；买入返售金融资产为 122.16 亿元，较上年末增加 120.73%，主要系公司股票质押式回购业务与交易所回购业务规模增加所致；应收款项为 12.54 亿元，较上年末增加 234.13%，主要系应收证券清算款增加以及融资

融券业务开展所致；可供出售金融资产为 264.83 亿元，较上年末增加 63.87%，主要系公司增加了债券、理财产品、信托计划以及对外股权投资规模等所致；持有至到期投资为 8.08 亿元，较上年末减少 46.41%，主要系本期理财产品、债券等到期所致；递延所得税资产为 4.02 亿元，较上年末增加 135.45%，主要系公司本期可供出售金融资产公允价值变动所致；其他资产为 16.09 亿元，较上年末减少 8.88%。

其中：公司境外资产 179,190,073.42 元（币种：人民币），占总资产的比例为 0.12%。

### 三、报告期内核心竞争力分析

#### 1、管理层高度重视战略布局，公司战略思路清晰明确

公司战略思路明确，将力争成为各项业务均衡发展，特色鲜明，具有重要影响力和一定国际竞争力的大型综合类券商。未来将坚持以调整及改善收入结构、积极寻求多业务发力点为主的战略思路，引进一流人才，建立高度市场化的激励机制。机构类业务方面，公司已基本在管理机制体制上构建机构类业务发展的基础，后续将持续强化业务协同和机制与业务发展方向的匹配，力求实现各类机构业务的跨越式发展；资产配置类业务方面，公司将采取多种方式提升买方业务的资产配置能力及获取长期稳定收益的投资能力；零售类业务方面，将继续依托数量位居行业前列的众多网点，推动分支机构服务的综合化、收入的多元化，实现零售业务向财富管理的转型。

#### 2、高效管理体制激发经营活力

公司秉承“开放包容、简单专注、勤奋坚持、追求卓越”一脉相承而又别具特色的企业精神。管理体制灵活，充分激发经营活力。公司设立执行委员会，作为落实公司董事会确定的经营方针和战略而设立的最高经营管理机构，对董事会负责。此举进一步规范了公司日常经营管理行为，有利于发挥集体智慧，建立更为科学、合理的决策机制和勤勉高效、民主集中的工作机制。在分支机构层面，公司实行精细化、标准化、扁平化、柔性化的管理模式充分激发营业部经营活力。

#### 3、网点与网络并重，线上与线下互补的全渠道优势

公司依托网点与网络并重，线上与线下互补的全渠道持续发展客户规模。公司拥有覆盖全国 28 个省（市、自治区）的 296 家（含民族证券和瑞信方正）证券营业网点，排名行业前列。公司拥有七千余名员工，队伍年轻且富有激情。广泛的业务渠道、庞大的客户基数和朝气蓬勃的员工队伍形成了公司的全渠道竞争优势，为公司围绕以客户为核心构建的业务模式提供了坚实基础。

#### 4、卓越的研究实力助力公司机构业务开展

研究实力是证券公司提供综合金融服务的前提与基础，也是影响公司客户获得更好服务体验的重要因素。公司研究所通过激励机制、团队建设、协同发展及对内服务升级等方面的不断投入，市场影响力逐步提高，综合实力已迈入行业第一梯队。另一方面研究所积极探索，重视业务创新，逐步融入公司各业务链条，积极发起重点机构类项目，激活并助力公司机构业务联动。

## 5、机构客户服务能力持续提高

公司机构业务条线围绕投研、产品、营销的核心竞争力，深化机构类业务机制体制改革，完善相关风险合规制度，各类机构业务布局逐步完善。报告期内公司构建了涵盖机构销售与交易、研究、QFII、产业金融、扶贫金融等各类机构业务一体化的机构与销售交易条线；并通过人才选用、考核与激励等途径，促进机构与销售交易条线、投行业务条线、子公司、分公司、营业部等各类机构业务之间的协同，致力于为机构客户提供一站式服务。

## 6、不断强化的风险管理能力

为配合业务的发展，公司高度重视中后台支撑体系的建设和人才的引进、培养工作。包括加强核心业务系统和互联网基础设施的 IT 系统建设，不断加强内控文化建设，提升全面风险管理能力，持续引进行业内优秀人才，完善人才梯队建设和人才选拔机制等，全面落实行业风险管理的最新要求，为公司业务的持续发展、健康发展提供强大的支持。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2016 年的证券市场大幅波动，截至年末上证综指报收 3103.64 点，深证成指报收 10177.14 点，分别较 2015 年末下跌 12.31%和 19.64%；市场交易量大幅萎缩，沪深两市股票基金交易额 138.91 万亿元，较上年下降 48.72%；行业收入大幅下降，全行业营业收入 3,279.94 亿元，较上年下降 42.97%。

在复杂多变的经营环境下，公司攻坚克难开拓进取，一手抓管理一手抓经营，取得了较好的经营成果。在战略布局上，公司坚持以调整及改善收入结构、积极寻求多业务发力点为主的战略思路，引进一流人才，建立高度市场化的激励机制，力争成为各项业务均衡发展，特色鲜明，具有重要影响力和一定国际竞争力的大型综合类券商。在管理机制上，公司完善了管理体系和组织架构，管理运营能力显著提升。在业务拓展方面，扎实推进机构业务、买方业务、资产管理业务、投资银行业务、新三板业务，积极推动各项业务的规范发展。

### 二、报告期内主要经营情况

2016 年公司实现营业收入 77.60 亿元，利润总额 31.62 亿元，归属于上市公司股东的净利润 25.69 亿元。截至 2016 年 12 月末，公司资产总额 1,523.39 亿元，归属于上市公司股东的净资产 354.29 亿元。

#### （一）主营业务分析

##### 1、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

| 项 目                | 本期数              | 上年同期数            | 变动幅度     | 变动原因说明                               |
|--------------------|------------------|------------------|----------|--------------------------------------|
| 手续费及佣金净收入          | 4,551,146,729.83 | 7,515,649,593.57 | -39.44%  | 主要系本期股市动荡行情低迷成交量减少，公司佣金收入减少所致。       |
| 其中：经纪业务手续费净收入      | 3,662,159,567.10 | 6,899,959,235.17 | -46.92%  | 主要系本期股市动荡行情低迷成交量减少，公司佣金收入减少所致。       |
| 投资银行业务<br>手续费净收入   | 581,827,025.98   | 363,900,109.81   | 59.89%   | 主要系本期公司合并民族投行收入所致。                   |
| 资产管理业务<br>手续费净收入   | 171,463,261.04   | 99,826,691.71    | 71.76%   | 主要系本期公司合并民族资管收入所致。                   |
| 利息净收入              | 81,725,773.39    | 806,812,027.93   | -89.87%  | 主要系本期公司两融利息收入减少以及负债规模增加导致利息支出增加所致。   |
| 投资收益               | 3,587,046,962.46 | 2,296,667,532.76 | 56.18%   | 主要系本期子公司处置可供出售金融资产与自营收益较好所致。         |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | -31,113,475.95   | -3,251,218.02    | 不适用      | 主要系本期子公司投资股权投资所致。                    |
| 公允价值变动收益           | -499,509,770.07  | 224,787,917.57   | -322.21% | 主要系本期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所致。 |
| 其他业务收入             | 36,866,185.32    | 69,221,876.60    | -46.74%  | 主要系本期咨询服务收入减少所致。                     |

|               |                    |                    |          |   |
|---------------|--------------------|--------------------|----------|---|
| 税金及附加         | 198,577,629.08     | 668,243,039.97     | -70.28%  | 主要系本期营改增政策影响所致。                                   |
| 资产减值损失        | 48,744,056.07      | 456,913,349.43     | -89.33%  | 主要系上期子公司计提资产减值损失所致。                               |
| 其他业务成本        | 5,185,178.47       | 36,531,141.60      | -85.81%  | 主要系本期咨询服务费支出减少所致。                                 |
| 营业外收入         | 65,811,674.56      | 41,186,187.45      | 59.79%   | 主要系本期政府补助增加所致。                                    |
| 营业外支出         | 54,317,965.31      | 114,521,441.74     | -52.57%  | 主要系上期计提未决诉讼所致。                                    |
| 所得税费用         | 579,797,104.99     | 1,348,970,822.74   | -57.02%  | 主要系本期应税收入减少所致。                                    |
| 净利润           | 2,582,322,310.91   | 4,098,493,582.57   | -36.99%  | 主要系本期行情低迷成交量减少，整体收入下滑所致。                          |
| 其他综合收益的税后净额   | -1,360,634,124.38  | 769,834,810.34     | -276.74% | 主要系本期子公司处置可供出售金融资产，以及可供出售金融资产公允价值变动影响所致。          |
| 综合收益总额        | 1,221,688,186.53   | 4,868,328,392.91   | -74.91%  | 主要系本期行情低迷成交量减少，整体收入下滑所致。                          |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -24,854,722,475.32 | -14,504,840,945.25 | 不适用      | 主要系本期股市动荡行情低迷成交量减少，代理买卖证券款大幅减少，以及融出资金减少与投资规模增加所致。 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 469,309,521.53     | 25,211,469,406.67  | -98.14%  | 主要系上期并购民族证券影响所致。                                  |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 4,102,837,454.12   | 24,437,904,024.99  | -83.21%  | 主要系本期发债规模较上年同期减少以及负债规模导致的利息增加所致。                  |

## 2、收入分析

2016 年，公司实现营业收入 77.60 亿元，同比减少 28.91%；实现归属于上市公司股东的净利润 25.69 亿元，同比减少 36.78%；实现每股收益 0.31 元，同比减少 36.73%；加权平均净资产收益率 7.31%，同比减少 5.10 个百分点。

2016 年，公司经纪及信用交易业务实现营业收入 62.79 亿元，同比减少 33.02%；证券自营业务实现营业收入 10.95 亿元，同比减少 35.20%；投资银行业务实现营业收入 5.91 亿元，同比增加 41.19%；资产管理业务实现营业收入 2.00 亿元，同比增加 72.72%。

## 3、成本分析

| 业务类别    | 成本构成项目        | 本期金额<br>(万元) | 本期占总成本比例 | 上年同期金额<br>(万元) | 上年同期占总成本比例 | 本期金额较上年同期变动比例 |
|---------|---------------|--------------|----------|----------------|------------|---------------|
| 经纪及信用交易 | 业务及管理费、税金及附加等 | 218,038.14   | 47.31%   | 247,329.26     | 45.85%     | -11.84%       |
| 自营投资    | 业务及管理费、税金及附加等 | 13,745.30    | 2.98%    | 13,223.92      | 2.45%      | 3.94%         |
| 资产管理    | 业务及管理费、税金及附加等 | 6,551.85     | 1.42%    | 5,373.51       | 1.00%      | 21.93%        |
| 投资银行    | 业务及管理费、税金及附加等 | 40,001.85    | 8.68%    | 29,986.06      | 5.56%      | 33.40%        |
| 总部及其他   | 业务及管理费、税金及附加等 | 182,589.97   | 39.61%   | 243,506.25     | 45.14%     | -25.02%       |
| 合计      |               | 460,927.11   | 100.00%  | 539,419.00     | 100.00%    | -14.55%       |

## 4、业务及管理费用

| 项目   | 本期数(万元)    | 本期占业务及管理费用比例 | 上年同期数(万元)  | 上年同期占业务及管理费用比例 | 变动幅度   |
|------|------------|--------------|------------|----------------|--------|
| 职工薪酬 | 273,358.41 | 62.74%       | 294,583.03 | 69.61%         | -7.20% |

|           |            |         |            |         |        |
|-----------|------------|---------|------------|---------|--------|
| 租赁费及物业费   | 32,797.94  | 7.53%   | 21,772.13  | 5.14%   | 50.64% |
| 营销费用      | 22,816.62  | 5.24%   | 17,066.00  | 4.03%   | 33.70% |
| 折旧摊销费     | 21,124.02  | 4.85%   | 15,218.06  | 3.60%   | 38.81% |
| 证券投资者保护基金 | 18,286.28  | 4.20%   | 12,768.35  | 3.02%   | 43.22% |
| 咨询费       | 10,528.54  | 2.42%   | 9,409.50   | 2.22%   | 11.89% |
| 差旅费       | 7,324.27   | 1.68%   | 4,798.27   | 1.13%   | 52.64% |
| 公杂费       | 6,975.61   | 1.60%   | 6,263.34   | 1.48%   | 11.37% |
| 邮电通讯费     | 6,291.25   | 1.44%   | 5,543.75   | 1.31%   | 13.48% |
| 其他        | 36,173.49  | 8.30%   | 35,827.82  | 8.46%   | 0.96%  |
| 小计        | 435,676.43 | 100.00% | 423,250.25 | 100.00% | 2.94%  |

## 5、现金流情况

2016 年度，公司现金及现金等价物净增加额为-202.75 亿元，主要是经营活动产生的现金流量净额减少所致。

### 5.1 经营活动产生的现金流量分析

经营活动产生的现金流量净额为-248.55 亿元，其中：

经营活动现金流入 282.80 亿元，占现金流入总量的 77.44%，主要包括：收取利息、手续费及佣金增加现金 88.84 亿元，融出资金净减少 79.64 亿元，收到其他与经营活动有关的现金增加 114.32 亿元（主要包括：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债净增加额 82.03 亿元，应付货币保证金净增加额 17.12 亿元，持有至到期投资净减少额 7.81 亿元，应付信托收益权转让净增加额 2.60 亿元，收回信托投资款 1.00 亿元，收回委托贷款投资 0.70 亿元等）。

经营活动现金流出 531.34 亿元，占现金流出总量的 93.56%，主要包括：客户交易结算资金减少 164.06 亿元，购入以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产现金流出 91.70 亿元，支付利息、手续费及佣金的现金 19.58 亿元，回购业务资金净减少 88.27 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 35.18 亿元，支付的各项税费 10.10 亿元，支付的其他与经营活动有关的现金 116.94 亿元（主要包括：可供出售金融资产现金净增加额 96.22 亿元，支付的营业费用及往来款 13.74 亿元，应收证券清算款净增加额 2.68 亿元，支付的投资者保护基金 1.65 亿元，受限资金净增加额 1.02 亿元）。

2016 年度经营活动产生的现金流量净额较 2015 年同期减少 103.50 亿元，主要系市场景气度下降，市场交投低迷，客户资金大幅下滑，回购业务融出资金增加以及金融资产规模增加所致。

### 5.2 投资活动产生的现金流量分析

投资活动产生的现金流量净额 4.69 亿元，其中：投资活动现金流入 9.85 亿元，占现金流入总量的 2.70%，主要为子公司存放银行的定期存款 8.00 亿元到期，收到与资产相关的政府补助 0.96 亿元，取得投资收益收到的现金 0.86 亿元。

投资活动现金流出 5.16 亿元，占现金流出总量的 0.91%，主要为投资支付的现金 3.45 亿元，购建固定资产和长期资产现金流出 1.71 亿元。

### 5.3 筹资活动产生的现金流量分析

筹资活动产生的现金流量净额 41.03 亿元，其中：筹资活动现金流入 72.43 亿元，占现金流入总量的 19.84%，系发行债券收到现金 30.00 亿元，收到其他与筹资活动有关的现金 40.50 亿元，吸收投资收到的现金 1.94 亿元。

筹资活动现金流出 31.40 亿元，占现金流出总量的 5.53%，主要系分配股利、利润或偿付利息支付的现金 31.40 亿元。

报告期内，公司经营活动产生的现金流量净额与本年度净利润存在差异，主要是因为客户交易结算资金净流出、回购业务净融出现金、增加投资规模以及融资融券业务融出资金等方面涉及大额现金的流入流出。

## （二）主营业务分行业情况

单位：万元 币种：人民币

| 项目      | 营业收入       | 营业成本       | 营业利润率  | 营业收入比上年同期增减 | 营业成本比上年同期增减 | 营业利润率比上年同期增减 |
|---------|------------|------------|--------|-------------|-------------|--------------|
| 经纪及信用交易 | 627,915.60 | 218,038.14 | 65.28% | -33.02%     | -11.84%     | -8.34%       |
| 自营投资    | 109,519.21 | 13,745.30  | 87.45% | -35.20%     | 3.94%       | -4.73%       |
| 资产管理    | 20,046.19  | 6,551.85   | 67.32% | 72.72%      | 21.93%      | 13.62%       |
| 投资银行    | 59,104.53  | 40,001.85  | 32.32% | 41.19%      | 33.40%      | 3.95%        |
| 总部及其他   | -40,595.85 | 182,589.97 | -      | -           | -25.02%     | -            |
| 合计      | 775,989.68 | 460,927.11 | 40.60% | -28.91%     | -14.55%     | -9.98%       |

### 1、经纪业务

报告期内，母公司和子公司实现代理买卖证券业务净收入 29.70 亿元，市场份额为 3.15%，新增客户 207 万户，期末总客户 790 万户，营业部 296 家。

#### 1.1 母公司经纪业务

报告期内，公司经纪业务在稳住现有业务优势基础上积极转型创新，逐步建立了独具公司特色的扁平化管理模式和标准化、精细化的经纪业务考核体系，实现了网络与网点并重，线上与线下互补，向互联网金融、财富管理和机构业务转型升级，推动了公司经纪业务持续快速增长。

2016 年，公司全年实现代理买卖证券业务净收入 23.42 亿元，市场份额为 2.49%，行业排名第 12 名，份额五年累计增幅达 52.01%。根据沪深两市交易所统计，公司全年沪深两市股票和基金成交量为 6.04 万亿元，市场份额为 2.18%，行业排名第 14 名，市场份额较上一年增长 14.22%。

公司立足现有 244 家营业部，充分发挥零售业务优势，多渠道引流，全年新开客户 184 万户，总客户 654 万户。公司稳步推进期权业务，全年新开户股票期权账户 4,891 个，市场份额为 4.09%，行业排名第 10 名。

2016 年，公司积极布局财富管理转型，全年实现 15 万客户签约投顾服务，同比增长 101%。

公司金融产品线进一步丰富，2016 年相继推出金泉友 2 号、金泉友灵活配置、现金港、资管量化系列等产品。报告期内，整体产品保有规模突破 300 亿（含民族证券），相较 2015 年末增幅达 100%，其中，金泉友灵活配置规模已突破 50 亿，现金港规模突破 60 亿。

2016 年，公司从互联网金融向金融科技持续升级，移动终端“小方”APP 构建极致交易、极速行情、智能投资顾问、综合理财等全业务支持的财富管理智能平台，3 项重大功能行业前三发布：移动版 Level-2 行情、小方牛智能投顾、小方必应 O2O 抢单。打造客户与员工双向连接沟通场景，O2O 营销客服体系全面落地。截止年末，客户移动端交易笔数占比 58.7%。在知名第三方数据统计机构的年度行业报告中显示，2016 年“小方”APP 月活复合增长率排名券商类应用第 3 名。

## 1.2 民族证券经纪业务

民族证券经纪业务整体运行平稳，在稳住现有业务优势基础上积极转型创新，聚焦开户引流、产品销售、机构客户及高净值客户的培育和开发，实现网络与网点并重，线上与线下互补，向互联网金融、财富管理和机构业务转型升级。

报告期内，民族证券经纪业务建立了完整的服务体系，包括投顾服务类、资讯信息类、软件工具类等，多维度服务客户，满足客户多元化需求；初步建立了门类齐全的金融产品体系，包括低起点的金小宝、金量宝、金大宝、现金港、银行理财，以及针对高净值客户的私募 FOF 产品、量化系列等。

## 1.3 瑞信方正经纪业务

2016 年 2 月 29 日，瑞信方正深圳前海证券营业部正式设立，并在 3 月 30 日取得经营证券业务许可证。经过各项准备工作，证券营业部于 2016 年 9 月 30 日正式对外营业。

## 2、自营业务

### 2.1 母公司自营业务

报告期内，公司自营业务有较大的发展。第一，自营规模逐年增长。自营资产规模由 2015 年底的 403 亿增长至 2016 年底的 550 亿，同比增长 37.2%；第二，自营投资品种进一步多元化。报告期内自营业务增加了权益投资和创新业务的配置规模，同时积极布局港股、黄金和期权衍生品等领域；第三，自营投资收益超越市场同期水平。自营业务权益投资和固定收益业务的投资收益率分别为-2.03%和 6.29%。第四，固定收益业务交易量大幅提升，市场知名度进一步提高。公司荣获中央国债登记结算有限责任公司评选的自营机构“债券业务进步奖”。

### 2.2 民族证券自营业务

报告期内，民族证券自营业务努力打造多元化收入结构，以灵活策略提高组合收益，全年业务规模 17.48 亿元，收益率为 9.39%。

## 3、资产管理业务

### 3.1 母公司资产管理业务

资产管理分公司加强了新业务领域的开拓，成功推出全新的量化系列产品，各资产管理计划均取得较好业绩。报告期内，公司资产管理分公司从管理体系、投研体系、产品体系、客户体系、人才体系“五位一体”加大战略布局，公司资产管理业务实施差异化经营，重点发展机构业务，为以银行为主的机构客户提供投融资一体化的综合资产管理服务，在规模、收入、客户数量等方面取得全面增长。报告期末，受托资产总规模 1,819.52 亿，同比增长 313.06%，其中集合资产管

理计划受托规模为 202.41 亿元；定向资产管理计划受托规模为 1,591.15 亿元；专向资产管理计划受托规模为 25.96 亿元。存续产品数量已升至 425 支，同比增长 338.14%。主动型管理业务规模超过 284.01 亿元，较期初增长 396.12%。

### 3.2 民族证券资产管理业务

报告期内，民族证券资产管理业务基本完成与母公司业务整合，主动管理类产品全部转移到方正证券，通道类业务部分转移到方正证券，剩余定向产品 16 只，规模 275.24 亿元，专项产品 4 只，规模 17.71 亿元。

### 3.3 方正富邦创融资产管理业务

方正富邦创融是方正富邦的全资子公司。报告期内方正富邦创融资产管理业务实施差异化经营，重点发展机构业务，为以银行为主的机构客户提供投融资一体化的综合资产管理服务，截至 2016 年 12 月 31 日，方正富邦创融专项资产管理规模约 984.41 亿元，并保持稳定增长的态势。

## 4、投资银行业务

### 4.1 民族证券投资银行业务

报告期内，民族证券投资银行业务优化组织架构，完善业务制度，借助整合契机，全力拓展业务，营业收入、公司分成利润、主承销规模、债券业务排名等指标均创历史新高。报告期内，主承销规模 385 亿元，较上年增长 46%；累计完成 IPO、再融资、财务顾问、公司债、企业债以及新三板等项目 69 个，较上年增长 109%。

### 4.2 瑞信方正投资银行业务

报告期内，瑞信方正总承销金额为 144.59 亿元人民币，共完成 17 个承销项目。

## 5、信用业务

### 5.1 母公司信用业务

公司 244 家营业部全部获准开展融资融券业务，实现网点融资融券服务的全覆盖。融资融券业务保持稳健发展，期末余额 172.9 亿元，期末市场份额为 1.84%；两融日均余额 168.98 亿元，日均市场份额为 1.88%。两融业务规模行业内排名第 16 位。

报告期内，公司累计开通约定购回交易权限的客户 1,082 户，新增初始交易金额 1.31 亿元，期末待购回金额 1.04 亿元；累计开通股票质押交易权限的客户 23,788 户，自有资金对接的初始交易金额累计 177.25 亿元，期末待购回金额 83.00 亿元。

### 5.2 民族证券信用业务

民族证券信用业务在严峻的市场环境下谨守合规底线保持平稳发展。报告期内，期末两融余额 58.34 亿元，市场份额 0.62%，两融日均余额 56.71 亿元，日均市场份额 0.63%，两融业务规模行业内排名第 41 位；期末自有资金对接的股票质押业务待购回金额 3.31 亿元。

## 6、新三板业务

公司全年新增挂牌 114 家，同比增长 138%，行业推荐挂牌家数排名第 13 名，较去年大幅提升；整体新增挂牌股份托管比例达到 97%；完成有效签约 148 家，保证了业务可持续发展。2016 年，公

司在全国中小企业股份转让系统有限责任公司的“主办券商执业质量”评价中排名靠前，得到市场同业及监管部门的充分肯定。随着新三板市场投资门槛降低、竞价交易推出、转板制度落地以及并购交易活跃的预期，新三板业务仍将快速发展。2017年，公司将继续引进高端人才，提高团队素质，深耕细作，全方位提高业务综合服务能力及盈利能力。

## 7、研究业务

2016年，公司研究所秉承“夯实基础研究能力，前瞻研究制胜”的理念，以大类资产配置为统领，以“定价能力”为核心，致力于全产业链研究，贯通一二级市场，为客户赢得倍增价值。公司研究所在宏观策略、军工、中小盘、传媒、有色、汽车、医药、食品饮料、电子、通讯、计算机、化工、环保与公用事业、金融工程、轻工、非银行金融、家电、房地产、新三板等领域持续扩大影响力；由任泽平博士领军的宏观策略团队，韩振国、李大军、杨仁文等带领的各产业研究团队，已经成为市场上最活跃的卖方研究机构之一。

2016年，公司研究所在新财富最佳分析师评选中获得优异成绩，机构类奖项包括进步最快研究机构第二名、本土最佳研究团队第八名、最佳销售服务团队第九名等；团队类奖项共有15个团队入围，9个团队上榜，包括军工研究团队第二名、中小市值研究团队第二名、传播与文化团队第二名、有色金属团队第二名、宏观经济团队第三名、汽车团队第三名、医药生物团队第三名、通信团队第四名、食品饮料团队第四名等，“水晶球奖”、“金牛奖”评比中公司也获得多个奖项。

## 8、期货业务

本公司的期货业务由控股子公司方正中期开展。2016年在金融期货持续受限的背景下，方正中期积极向商品期货转型，一方面发挥网点的产业地缘优势，深耕产业链的开发与服务；另一方面积极向资管及风险管理业务转型。

2016年度方正中期净增开户数21,586户，同比增长20.11%；期末客户权益70.30亿元，同比增长15.29%；客户成交量18,024.12万手，同比增长24.36%，其中商品期货成交量同比增长42.62%，增幅优于行业平均水平。

## 9、直接投资业务

本公司的直接投资业务由全资子公司方正和生开展。2016年，方正和生及其下属直投基金新增股权投资项目13个，累计投资金额达13.04亿元；新设立3只直投基金，涵盖跨境投资、创新创业、新材料等领域。报告期内，方正和生实现投资项目的退出，营业收入达12.46亿元。2016年，方正和生获得包括“年度最佳私募股权投资机构”、“年度私募股权投资机构”等多个奖项。

## 10、基金管理业务

本公司的基金管理业务由控股子公司方正富邦开展。2016年，方正富邦发行并管理9支公募基金产品，管理资产规模160.21亿元；专户业务管理29支专户产品，管理资产规模158.27亿元；方正富邦基金管理业务品种逐渐多样化，基本形成涵盖权益型、指数型、债券型和货币型的产品线，资产管理规模也在不断提升。

## 11、另类投资业务

本公司的另类投资业务由全资子公司方正投资开展。方正投资致力于对有稳健投资回报以及持续成长性的优质项目进行投资和管理，并为目标客户定制多元化的投资增值服务。2016 年方正投资把握投资机会，在市场收益水平下行的情况下取得较好的投资收益，实现投资绝对收益率 9.08%。同时，根据证券业协会《证券公司另类投资子公司管理规范》，方正投资不断完善组织架构、进行业务调整，以符合新的监管政策。

## 12、境外业务

本公司的境外业务由全资子公司方正香港开展。方正香港是方正证券国际化战略的重要平台。2016 年方正香港完善了公司治理架构，制定了以机构和高净值客户为重点，以投行模式和资本驱动为核心的发展战略。方正香港已有三家取得金融牌照的子公司，分别从事证券交易、期货交易、资产管理业务。2016 年积累的境外债券融资项目，有望带动 2017 年营业收入的增长。

## 13、代销金融产品

2016 年公司加强了产品销售管理体系建设，积极完善金融产品销售管理制度，优化系统平台，丰富产品。顺应市场行情的发展，积极寻求满足各类客户需求的产品，产品涵盖了权益类、类固收类、货币类、另类投资产品等，为客户提供了多元化的资产配置服务，为客户创造了收益。

报告期内，公司代销金融产品规模 3,542.23 亿元（含民族证券），实现销售收入 2,183.79 万元（含民族证券）。

## 14、其他创新业务发展情况

2016 年公司抓住市场时机，适时增加了非标产品配置，实现了投资规模较快增长。同时，公司加大对信用研究和产品研究的投入，并通过修订制度来优化投资决策和投资管理流程，为公司创新投资的安全、收益及发展提供了坚实的基础。

2016 年公司积极布局财富管理转型，依托实力强大的投研和投顾团队，凭借业内领先的“泉友会”服务体系和多元化服务产品，结合移动互联网平台，打造线上线下一体化的全业务闭环，通过全方位客户服务，满足多层次客户需求，提供良好的客户体验。

### （三）主营业务分地区情况

#### 1、营业收入地区分布情况

单位：元 币种：人民币

| 地区  | 2016 年 |                  | 2015 年 |                  | 增减百分比   |
|-----|--------|------------------|--------|------------------|---------|
|     | 营业部家数  | 营业收入             | 营业部家数  | 营业收入             |         |
| 湖南省 | 101    | 1,137,323,717.53 | 101    | 3,208,344,742.04 | -64.55% |
| 浙江省 | 47     | 598,081,941.95   | 47     | 1,384,821,699.54 | -56.81% |
| 北京市 | 10     | 192,085,536.68   | 10     | 265,692,813.18   | -27.70% |
| 广东省 | 18     | 174,201,405.19   | 17     | 291,321,257.66   | -40.20% |
| 河南省 | 23     | 90,930,112.37    | 23     | 182,116,593.64   | -50.07% |
| 上海市 | 9      | 110,192,918.74   | 9      | 161,258,971.03   | -31.67% |
| 河北省 | 5      | 47,834,777.82    | 5      | 56,079,663.08    | -14.70% |
| 贵州省 | 4      | 18,024,874.51    | 4      | 44,978,101.32    | -59.93% |

|          |     |                  |     |                   |         |
|----------|-----|------------------|-----|-------------------|---------|
| 云南省      | 5   | 16,760,718.20    | 5   | 37,082,842.43     | -54.80% |
| 陕西省      | 3   | 20,356,443.74    | 3   | 31,585,042.36     | -35.55% |
| 重庆市      | 2   | 11,570,881.27    | 2   | 30,986,012.42     | -62.66% |
| 江苏省      | 7   | 46,353,897.58    | 7   | 48,516,220.86     | -4.46%  |
| 江西省      | 5   | 17,421,144.94    | 5   | 38,312,381.42     | -54.53% |
| 天津市      | 5   | 30,060,903.87    | 5   | 37,620,196.65     | -20.09% |
| 山西省      | 3   | 12,466,826.89    | 3   | 29,330,156.58     | -57.49% |
| 湖北省      | 4   | 4,361,376.18     | 4   | 12,419,897.35     | -64.88% |
| 安徽省      | 2   | 4,365,559.28     | 2   | 6,807,931.64      | -35.88% |
| 广西壮族自治区  | 4   | 9,069,402.71     | 4   | 13,653,062.40     | -33.57% |
| 山东省      | 7   | 12,311,536.52    | 7   | 26,695,860.62     | -53.88% |
| 四川省      | 7   | 89,836,360.22    | 7   | 60,332,117.34     | 48.90%  |
| 福建省      | 4   | 25,698,584.91    | 4   | 13,330,563.17     | 92.78%  |
| 黑龙江省     | 2   | 11,099,788.62    | 2   | 7,317,274.40      | 51.69%  |
| 吉林省      | 7   | 84,233,302.97    | 7   | 63,794,423.20     | 32.04%  |
| 辽宁省      | 9   | 168,102,155.91   | 9   | 105,127,575.31    | 59.90%  |
| 甘肃省      | 1   | 753,080.74       | 1   | 69,205.46         | 988.18% |
| 内蒙古自治区   | 1   | 10,092,232.61    | 1   | 4,910,536.00      | 105.52% |
| 新疆维吾尔自治区 | 1   | 13,651,413.23    | 1   | 7,682,010.18      | 77.71%  |
| 营业部小计    | 296 | 2,957,240,895.18 | 295 | 6,170,187,151.28  | -52.07% |
| 本部及子公司   |     | 4,802,655,943.96 |     | 4,744,802,555.34  | 1.22%   |
| 合计       | 296 | 7,759,896,839.14 | 295 | 10,914,989,706.62 | -28.91% |

## 2、营业利润地区分布报告

单位:元 币种:人民币

| 地区      | 2016 年 |                | 2015 年 |                  | 增减百分比    |
|---------|--------|----------------|--------|------------------|----------|
|         | 营业部家数  | 营业利润           | 营业部家数  | 营业利润             |          |
| 湖南省     | 101    | 579,148,541.77 | 101    | 2,397,510,414.65 | -75.84%  |
| 浙江省     | 47     | 286,026,368.68 | 47     | 996,924,167.14   | -71.31%  |
| 北京市     | 10     | 87,669,220.32  | 10     | 172,520,046.16   | -49.18%  |
| 广东省     | 18     | 71,556,698.58  | 17     | 177,180,466.67   | -59.61%  |
| 河南省     | 23     | 12,344,811.07  | 23     | 102,231,396.39   | -87.92%  |
| 上海市     | 9      | 44,058,548.70  | 9      | 104,477,723.24   | -57.83%  |
| 河北省     | 5      | 18,268,070.36  | 5      | 32,702,693.04    | -44.14%  |
| 贵州省     | 4      | 5,747,814.97   | 4      | 29,996,019.10    | -80.84%  |
| 云南省     | 5      | 1,238,153.53   | 5      | 22,738,732.93    | -94.55%  |
| 陕西省     | 3      | 2,801,343.12   | 3      | 16,559,189.52    | -83.08%  |
| 重庆市     | 2      | 776,167.25     | 2      | 18,480,151.09    | -95.80%  |
| 江苏省     | 7      | 13,499,364.05  | 7      | 24,984,996.92    | -45.97%  |
| 江西省     | 5      | -5,202,944.84  | 5      | 21,363,512.39    | -124.35% |
| 天津市     | 5      | 7,353,024.86   | 5      | 20,946,257.55    | -64.90%  |
| 山西省     | 3      | -223,666.36    | 3      | 15,622,726.46    | -101.43% |
| 湖北省     | 4      | -5,411,538.73  | 4      | 2,439,542.90     | -321.83% |
| 安徽省     | 2      | -4,603,351.34  | 2      | -1,284,760.64    | -        |
| 广西壮族自治区 | 4      | -924,090.57    | 4      | 3,231,508.09     | -128.60% |
| 山东省     | 7      | -6,978,803.79  | 7      | 11,685,520.48    | -159.72% |
| 四川省     | 7      | 44,868,929.70  | 7      | 32,366,848.85    | 38.63%   |
| 福建省     | 4      | 2,568,651.41   | 4      | -351,216.45      | -        |

|          |     |                  |     |                  |         |
|----------|-----|------------------|-----|------------------|---------|
| 黑龙江省     | 2   | 1,566,060.92     | 2   | 3,139,038.15     | -50.11% |
| 吉林省      | 7   | 31,267,134.73    | 7   | 34,499,170.58    | -9.37%  |
| 辽宁省      | 9   | 82,044,813.42    | 9   | 58,666,632.17    | 39.85%  |
| 内蒙古自治区   | 1   | 3,184,175.69     | 1   | 1,646,458.45     | 93.40%  |
| 新疆维吾尔自治区 | 1   | 4,142,274.29     | 1   | 2,842,941.62     | 45.70%  |
| 甘肃省      | 1   | -1,726,591.52    | 1   | -749,430.64      | -       |
| 营业部小计    | 296 | 1,275,059,180.27 | 295 | 4,302,370,746.81 | -70.36% |
| 本部及子公司   |     | 1,875,566,526.38 |     | 1,218,428,912.79 | 53.93%  |
| 合计       | 296 | 3,150,625,706.65 | 295 | 5,520,799,659.60 | -42.93% |

#### (四) 资产、负债情况分析

##### 1、资产负债表变动情况及原因分析

单位:元 币种:人民币

| 资产负债表项目                | 本期期末数             | 本期期末数占总资产/总负债的比例 | 上期期末数             | 上期期末数占总资产/总负债的比例 | 本期期末金额较上期期末变动比例 | 变动原因说明                           |
|------------------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|-----------------|----------------------------------|
| 货币资金                   | 31,653,009,147.22 | 20.78%           | 47,771,925,975.36 | 30.94%           | -33.74%         | 主要系受行业景气度影响,客户资金减少所致。            |
| 结算备付金                  | 10,401,675,865.84 | 6.83%            | 15,255,694,188.31 | 9.88%            | -31.82%         | 主要系受行业景气度影响,客户资金减少所致。            |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 35,133,307,565.31 | 23.06%           | 25,019,830,145.82 | 16.20%           | 40.42%          | 主要系公司增加了债券、基金投资规模所致。             |
| 买入返售金融资产               | 12,215,615,748.75 | 8.02%            | 5,534,275,243.41  | 3.58%            | 120.73%         | 主要系股票质押式回购业务与债券回购业务规模增加所致。       |
| 应收款项                   | 1,253,956,700.86  | 0.82%            | 375,289,398.50    | 0.24%            | 234.13%         | 主要系应收证券清算款以及融资融券业务开展所致。          |
| 可供出售金融资产               | 26,483,424,940.30 | 17.38%           | 16,160,875,630.78 | 10.47%           | 63.87%          | 主要系公司增加了债券、理财产品、信托计划以及股权投资规模等所致。 |
| 持有至到期投资                | 807,508,824.56    | 0.53%            | 1,506,828,351.55  | 0.98%            | -46.41%         | 主要系本期理财产品、债券等到期所致。               |
| 递延所得税资产                | 402,195,391.12    | 0.26%            | 170,817,003.17    | 0.11%            | 135.45%         | 主要系公司本期可供出售金融资产公允价值变动所致。         |
| 应付短期融资款                | 11,039,500,000.00 | 9.51%            | 5,528,760,000.00  | 4.65%            | 99.67%          | 主要系本期发行短期公司债与收益凭证所致。             |
| 拆入资金                   |                   |                  | 552,000,000.00    | 0.46%            | -100.00%        | 主要系本期未开展资金拆入业务所致。                |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 10,109,468,691.68 | 8.70%            | 1,668,996,284.93  | 1.40%            | 505.72%         | 主要系本期结构化产品份额变化所致。                |
| 代理买卖证券款                | 30,832,708,036.73 | 26.55%           | 47,238,807,439.34 | 39.73%           | -34.73%         | 主要系受行业景气度影响,客户资金减少所致。            |

|         |                  |       |                  |       |         |                            |
|---------|------------------|-------|------------------|-------|---------|----------------------------|
| 应付职工薪酬  | 1,142,427,749.57 | 0.98% | 1,925,286,089.82 | 1.62% | -40.66% | 主要系本期支付绩效所致。               |
| 应交税费    | 195,977,926.95   | 0.17% | 317,341,725.37   | 0.27% | -38.24% | 主要系本期应税收入减少所致。             |
| 应付款项    | 7,357,311,486.55 | 6.33% | 5,320,149,484.08 | 4.47% | 38.29%  | 主要系公司本期应付货币保证金增加所致。        |
| 递延所得税负债 | 7,858,734.95     | 0.01% | 162,413,654.18   | 0.14% | -95.16% | 主要系本期处置可供出售金融资产及其公允价值变动所致。 |
| 其他负债    | 701,966,337.02   | 0.60% | 436,292,980.92   | 0.37% | 60.89%  | 本期子公司信托受益权转让增加所致。          |

## 2、资产结构和资产质量

截至 2016 年末，公司资产总额 1,523.39 亿元，较年初减少 20.86 亿元，下降 1.35%；公司负债总额 1,161.42 亿元，较年初减少 27.59 亿元，下降 2.32%。

截至 2016 年末，扣除客户交易结算资金后，公司的资产总额为 1,215.06 亿元，较年初增加 143.20 亿元，增长 13.36%。扣除客户资金存款后的公司资产结构如下：货币资金及结算备付金 112.22 亿元，占总资产的 9.24%；融出资金（包括融出资金、买入返售金融资产）为 352.97 亿元，占资产总额的 29.05%；以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产和持有至到期投资金融资产为 624.24 亿元，占资产总额的 51.38%，其中以成本计量的股权投资占比为 5.62%；其他流动资产 65.22 亿元，占资产总额的 5.37%；商誉为 45.23 亿元，占资产总额的 3.72%；固定资产等其他非流动资产合计 15.18 亿元，占 1.25%。报告期内，可供出售金融资产减值准备余额为 4,947.33 万元；根据单一、无担保的信用投资的减值准备政策，民族证券 20.5 亿元信托投资减值准备余额为 5.22 亿元，其它资产均未出现重大减值迹象，资产质量保持优良。公司资产结构配置兼顾了各类资产的流动性及收益性，符合公司的战略安排及发展需要。

截至 2016 年末，扣除客户交易结算资金后，公司的负债总额为 853.09 亿元，较年初增加 136.48 亿元，增长 19.04%。其中，卖出回购证券款 194.60 亿元，占比 22.81%；应付短期融资款、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 211.49 亿元，占比 24.79%；应付债券 335.00 亿元，占比 39.27%；应付货币保证金 67.81 亿元，占比 7.95%；其他负债合计金额 44.19 亿元，占比 5.18%。截至 2016 年末，公司扣除代理买卖证券款的资产负债率为 70.21%。

报告期末，母公司净资本 218.59 亿元，净资本与负债比例为 35.71%，净资产与负债比例为 56.86%，各项风险控制指标均符合《证券公司风险控制指标管理办法》的有关规定。

### （五）融资渠道、长短期负债结构分析

#### 1、公司融资渠道

主要包括发行债务融资工具、资产收益权转让、同业拆借、债券质押式与买断式回购等。2016 年公司主要通过同业拆借、债券质押式与买断式回购、报价回购、两融收益权转让、股票质押收益权转让、发行次级债、短期公司债和收益凭证等方式融入资金。

#### 2、公司融资情况

报告期末，公司通过债券质押式与买断式回购存量 145.25 亿元、报价回购存量 6.04 亿元、两融收益权转让存量 12.5 亿元、股票质押收益权转让存量 2.46 亿元、次级债存量 288 亿元、短期公司债存量 60 亿元、收益凭证存量 67.40 亿元。

### 3、公司负债结构

报告期末，公司总负债 853.09 亿元（扣除经纪业务客户交易结算资金 308.33 亿元），其中：应付债券 335.00 亿元、卖出回购金融资产款 194.60 亿元、应付短期融资款 110.40 亿元、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 101.09 亿元、应付货币保证金 67.81 亿元、应付利息 14.88 亿元、应付职工薪酬 11.42 亿元、预计负债 2.94 亿元、其他负债 14.95 亿元。报告期末公司无重大逾期未偿还的债务。

### 4、公司为维护流动性水平所采取的措施

公司坚持资金的统一管理和运作，建立和完善资金管理体系建设，为维护流动性水平采取如下措施：

为保障公司资产的安全性与流动性，公司制定了《流动性风险管理办法》，明确公司流动性风险管理的基本原则、组织架构和职责分工、流动性风险管理方法、流动性风险报告等。

公司建立并严格落实净资本和流动性风险的日常监控、管理措施，新业务、新产品和重大投资前对流动性、净资本等相关指标做压力测试。

公司定期监控短期和长期的流动资金需求，以确保维持充裕的现金储备和可供随时变现的有价证券。

为保障创新业务和其他重大投资业务对流动性的需求预留资金。

为提高流动性和流动性风险管理效率和准确性、及时性，公司建立了自有资金管理系统，通过系统统一管理公司的资产、负债和自有资金。

### 5、公司融资能力分析

公司严格把控风险，经营规范，资产优良，将继续与各大商业银行、保险公司、基金公司等金融机构保持良好的合作关系，通过同业拆借、债券质押式与买断式回购、报价回购、转融通、两融收益权转让、股票质押收益权转让、发行债券、收益凭证及其他经主管部门批准的方式进行融资，从而满足公司业务对资金的需求，确保公司经营管理目标的实现。

## （六）投资状况分析

### 1、对外股权投资总体分析

单位：万元 币种：人民币

| 项目       | 金额             |
|----------|----------------|
| 报告期内投资额  | 13,340.00      |
| 上年同期投资额  | 3,000.00       |
| 被投资的公司名称 | 占被投资公司权益的比例(%) |
| 方正富邦     | 66.67          |

### 2、证券投资情况

单位:元 币种:人民币

| 序号           | 证券品种 | 证券代码   | 证券简称 | 持有数量(股)        | 最初投资成本(元)      | 期末账面(元)        | 占期末证券投资比例(%) | 报告期损益(元)       |
|--------------|------|--------|------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 1            | 股票   | 600850 | 华东电脑 | 4,394,982.00   | 118,612,623.05 | 106,270,664.76 | 14.31        | -11,165,590.52 |
| 2            | 股票   | 600580 | 卧龙电气 | 10,640,900.00  | 110,342,104.48 | 96,832,190.00  | 13.04        | -38,451,089.07 |
| 3            | 股票   | 600363 | 联创光电 | 3,627,800.00   | 63,103,286.89  | 59,858,700.00  | 8.06         | -10,479,795.12 |
| 4            | 股票   | 600016 | 民生银行 | 3,435,381.00   | 31,306,022.58  | 31,193,259.48  | 4.20         | -982,787.58    |
| 5            | 股票   | 002534 | 杭锅股份 | 2,636,436.00   | 27,527,903.35  | 29,422,625.76  | 3.96         | 4,011,532.47   |
| 6            | 股票   | 601939 | 建设银行 | 4,150,831.00   | 22,673,015.10  | 22,580,520.64  | 3.04         | 1,231,553.73   |
| 7            | 股票   | 601009 | 南京银行 | 2,001,200.00   | 23,770,056.34  | 21,693,008.00  | 2.92         | -2,201,982.16  |
| 8            | 股票   | 300182 | 捷成股份 | 1,416,000.00   | 15,026,853.80  | 14,598,960.00  | 1.97         | -2,680,774.64  |
| 9            | 股票   | 300233 | 金城医药 | 566,200.00     | 13,473,915.06  | 13,798,294.00  | 1.86         | -3,139,371.11  |
| 10           | 股票   | 000709 | 河北钢铁 | 4,000,000.00   | 13,353,000.00  | 13,360,000.00  | 1.80         | 7,024.96       |
| 持有的其他证券投资    |      |        |      | 70,995,008.00  | 358,277,776.92 | 332,985,875.44 | 44.84        | 13,483,614.31  |
| 报告期已出售证券投资损益 |      |        |      |                | -              | -              | -            |                |
| 合计           |      |        |      | 107,864,738.00 | 797,466,557.57 | 742,594,098.08 | 100.00       | -50,367,664.73 |

### 3、持有其他上市公司股权情况

单位:元 币种:人民币

| 证券简称     | 证券代码   | 最初投资成本        | 占该公司股权比例(%) | 期末账面价值        | 报告期损益         | 报告期所有者权益变动     | 会计核算科目   | 股份来源 |
|----------|--------|---------------|-------------|---------------|---------------|----------------|----------|------|
| 南洋3      | 400023 | 250,000.00    | 0.249       | 2,598,750.00  | -             | -              | 可供出售金融资产 | 三板市场 |
| 荃银高科     | 300087 | 3,975,615.25  | 0.096       | 4,061,610.00  | 1,419,305.68  | 85,994.75      |          | 二级市场 |
| 华录百纳     | 300291 | 6,545,032.10  | 0.032       | 5,760,159.80  | -             | -784,872.30    |          | 二级市场 |
| 华业地产     | 600240 | 3,504,784.19  | 0.023       | 3,544,200.00  | -638,229.59   | 39,415.81      |          | 二级市场 |
| 欧菲光      | 002456 | 8,894,834.83  | 0.023       | 8,615,695.24  | -             | -279,139.59    |          | 二级市场 |
| 三友化工     | 600409 | 2,072,753.73  | 0.014       | 2,356,138.80  | 3,513,457.02  | 283,385.07     |          | 二级市场 |
| 捷成股份     | 300182 | 2,285,910.10  | 0.009       | 2,268,200.00  | -971,144.62   | -17,710.10     |          | 二级市场 |
| 云南白药     | 000538 | 4,994,988.11  | 0.007       | 5,947,315.00  | -             | 952,326.89     |          | 二级市场 |
| 中泰化学     | 002092 | 1,185,105.10  | 0.005       | 1,210,000.00  | 831,717.19    | 24,894.90      |          | 二级市场 |
| 机器人      | 300024 | 422,699.34    | 0.003       | 1,152,382.00  | -             | -525,868.00    |          | 二级市场 |
| 其他上市公司股权 |        | 51,913,749.98 |             | 43,393,692.08 | 13,492,784.73 | -19,607,986.94 |          |      |
| 合计       |        | 86,045,472.73 | -           | 80,908,142.92 | 17,647,890.41 | -19,829,559.51 |          |      |

### 4、持有非上市金融企业股权情况

单位:元 币种:人民币

| 所持对象名称       | 初始投资金额           | 持有数量(股)        | 期末账面价值           | 报告期损益         | 报告期股东权益变动 | 会计核算科目   | 股份来源 |
|--------------|------------------|----------------|------------------|---------------|-----------|----------|------|
| 盛京银行股份有限公司   | 1,500,000,000.00 | 300,000,000.00 | 2,377,144,225.64 | 84,000,000.00 |           | 可供出售金融资产 | 出资认购 |
| 广东南粤银行股份有限公司 | 13,000,000.00    | 16,900,000.00  | 13,000,000.00    | 803,400.00    |           |          | 债转股  |

|                 |                  |   |                  |               |   |   |      |
|-----------------|------------------|---|------------------|---------------|---|---|------|
| 中证机构间报价系统股份有限公司 | 30,000,000.00    |   | 30,000,000.00    |               |   |   | 出资认购 |
| 合计              | 1,543,000,000.00 | - | 2,420,144,225.64 | 84,803,400.00 | - | - | -    |

注 1：金融企业包括商业银行、证券公司、保险公司、信托公司、期货公司等；

注 2：报告期损益：该项投资对公司本报告期合并报表净利润的影响。

### （七）主要控股参股公司分析

#### 1、民族证券

民族证券注册资本 448,655 万元，为公司全资子公司。截至 2016 年 12 月 31 日，民族证券总资产 2,247,826.42 万元，净资产 812,707.10 万元；2016 年实现营业收入 144,841.27 万元，净利润 37,407.02 万元。

#### 2、方正和生

方正和生注册资本 170,000 万元，为公司全资子公司。截至 2016 年 12 月 31 日，方正和生总资产 341,047.14 万元，净资产 275,808.98 万元；2016 年实现营业收入 124,615.79 万元，净利润 105,009.70 万元。

#### 3、瑞信方正

瑞信方正注册资本 80,000 万元，公司持有 66.7%的股权。截至 2016 年 12 月 31 日，瑞信方正的总资产 89,196.18 万元，净资产 86,311.65 万元；2016 年实现营业收入 17,957.79 万元，净利润 327.71 万元。

#### 4、方正中期（含上海际丰）

方正中期注册资本 34,000 万元，公司持有 90.62%的股权。截至 2016 年 12 月 31 日，方正中期总资产 813,639.97 万元，净资产 93,934.39 万元；2016 年实现营业收入 55,153.48 万元，净利润 15,603.58 万元。

#### 5、方正投资

方正投资注册资本 30,000 万元，为公司全资子公司。截至 2016 年 12 月 31 日，方正投资总资产 58,100.07 万元，净资产 29,595.87 万元；2016 年实现营业收入 3,161.91 万元，净利润 -204.02 万元。

#### 6、方正富邦（含方正富邦创融）

方正富邦注册资本 40,000.00 万元，公司持有 66.7%的股权。截至 2016 年 12 月 31 日，方正富邦总资产 37,701.83 万元，净资产 29,834.48 万元；2016 年实现营业收入 15,429.50 万元，净利润 504.59 万元。

#### 7、方正香港

方正香港注册资本 1 亿港元，为公司的全资子公司。截至 2016 年 12 月 31 日，公司总资产 14,231.89 万元，净资产 4,336.05 万元；2016 年实现营业收入 479.68 万元，净利润 -3,389.34 万元。

### 三、关于公司未来发展的讨论与分析

#### (一) 行业格局和趋势

2016 年以来，宏观经济政策、资本市场与行业监管发生了许多变化。一是资本市场以服务实体经济为中心的定位更加明确，供给侧结构性改革、国企改革等宏观经济政策催生了更多的发展机会。二是在加强风险防范、抑制资产泡沫的总要求下，在证券行业发展更加规范、监管更加严格的背景下，以功能放开为主的创新红利将减少，而业务模式创新、跨界整合创新、金融科技应用创新等要求更高的创新将会风起云涌。

#### 1、中国资本市场正处于战略机遇期，证券行业具有广阔的发展前景

随着国家供给侧改革的深化，企业投融资需求旺盛，国企改革、并购重组、不良资产处置等新的市场机遇将持续涌现。中国的资本市场以服务实体经济为中心，正在开启新一轮的发展，为证券行业的成长提供广阔的发展空间。在利率市场化、人民币国际化和社会财富持续增加的大背景下，大量资金迫切寻求高质量的投资与理财机会，这将为行业做大财富管理、资产管理、跨境投资等业务提供难得的发展机遇。证券行业正面临资本市场深化发展和监管层鼓励证券公司做大做强历史性发展机遇，行业的增长空间巨大。

#### 2、量价萎缩背景下，行业积极寻找转型

佣金率探底、交易量萎缩的压力下，行业积极寻求转型。主要发力点在于：第一，向机构业务转型。2016 年以来，以投行、资管、利息收入为代表的机构业务收入占比持续提升，成为行业的重要收入来源。随着机构投资者参与比例的不不断提升，以及企业投融资需求的不断多元化，构建机构业务的综合实力将成为行业发展的重要着力点。第二，传统零售向财富管理转型。随着中国经济的不断发展，高净值客户群体占比不断提高，催生资产多元化配置的需求。财富管理市场体量巨大，将是证券行业不断深入挖潜的重要领域。第三，传统线下展业模式向科技化金融发展。先进的信息技术正不断改变证券行业的竞争形势，线上营业厅、手机 APP、智能投顾、大数据分析等互联网竞争模式层出不穷，成为证券行业竞争的新战场。

#### 3、混业经营下竞争格局从行内竞争延伸到跨界竞争

随着混业经营的日益临近，互联网金融的加快推进，证券行业将面临市场参与者倍增、佣金快速下滑等前所未有的严峻挑战。证券公司不仅要与同业争抢市场，还要面对银行、保险的逼人攻势，以及拥有互联网技术、思维与平台，不断突破规则并创造规则的互联网金融公司的凌厉冲击。

过去是行业内竞争，未来更主要的挑战是应对跨界竞争。以往我们是在牌照下、在行业内靠打拼市场份额来竞争，未来是要与更大更强的金融企业开展混业竞争。牌照的放开和大金融时代的到来，将使得证券公司作为资本市场核心组织者的地位面临严峻挑战。

#### (二) 公司发展战略

公司将力争成为各项业务均衡发展，特色鲜明，具有重要影响力和一定国际竞争力的大型综合类券商。未来将坚持以调整及改善收入结构、积极寻求多业务发力点为主的战略思路，引进一

流人才，建立高度市场化的激励机制。在寻求业务突破方面，公司将依托研究、传统经纪业务的发展带动机构类业务发展；将快速构建并提升公司买方业务的资产配置能力及获取长期稳定收益的投资能力；深化互联网金融的战略布局，从而提升客户数量和客户服务能力，实现零售业务向财富管理的转型，促进公司营业网点服务的综合化、收入形式的多元化。

### （三）经营计划

2017 年，世界经济复苏仍然乏力，国内经济发展以稳为主基调，着力防控风险。在房地产投资受限、人民币贬值、无风险利率上行的情况下，充足的流动性或将向资本市场流动，市场活力有望回升。但市场大幅波动及监管的政策导向存在较大的不确定因素。

2017 年公司将根据“成为各项业务均衡发展，特色鲜明，具有重要影响力和一定国际竞争力的大型综合类券商”的既定战略目标，继续强化合规风控，推进与民族证券的整合，推动各类业务转型，全面提升管理与业务水平。具体如下：

#### 1、公司管理方面

2017 年公司将继续建立并完善全面风控、合规体系建设，以适应不断提升的监管要求以及不断升级的业务需求；还将继续深化、扩大协同体系的构建，从组织架构、考核激励、合规管理等方面进行综合考虑，从制度上最大限度激发各条线潜力；进一步强化组织队伍建设，对标行业领先券商，持续提升组织效率，搭建适宜公司发展阶段的组织架构和机制，强化激励制度与公司战略的匹配，推动业务转型。

#### 2、机构业务方面

继续完善机构业务体系，充实产品和服务谱系，充分发挥分公司作用，强化与母公司各业务之间的协同；研究所加强对内服务，提升公司大客户综合服务能力；大投行业务向多元化、综合化转型，全面提升经营实力；新三板从单一挂牌向投行综合业务转型；做好扶贫工作，发掘业务机会。

#### 3、资管业务方面

继续布新局、调结构、提能力、强营销。以客户为中心，深耕分支机构资源，强化跨条线协同，积极提升主动管理竞争能力。

#### 4、经纪业务方面

继续推进经纪从传统代理买卖证券向财富管理转型，做大客户资产，提升金融产品销售，显著提升营业部综合化经营水平。

#### 5、买方业务方面

继续丰富资产负债配置规模和品种，提升获取长期稳定回报的能力；根据监管要求，明确另类投资子公司战略定位，提升综合竞争实力。

### （四）可能面对的风险

#### 1、信用风险

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约而带来损失的风险。

公司信用风险主要来自两方面：一是融资融券、约定购回式证券交易（以下简称约定购回）、股票质押式回购交易（以下简称股票质押回购）等信用业务客户违约给带来损失的风险；二是债券等金融产品投资的违约风险，即所投产品之发行人、融资人或交易对手出现违约、拒绝支付到期款项，导致资产损失和收益变化的风险。

信用风险和市场风险具有一定的相关性。在市场波动的情况下，公司在相关金融产品和交易上的信用风险敞口也会随之发生变化。因此，公司对市场风险的一些监控和防范手段也能够对信用风险的管理发挥作用。

在融资融券、约定购回和股票质押回购业务等信用业务方面，本公司的信用风险控制主要通过对客户风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式实现。

由于历史原因遗留、账龄较长以及发生坏账的融出资金等存在信用风险，本公司已对单项金额重大的应收款项均全额计提了坏账准备，本公司应收款项账面金额减去相应的坏账准备代表了本公司资产负债表日应收款项信用风险敞口。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本公司的信用风险敞口为金融资产的账面价值扣除已确认的减值准备后的余额。对于以公允价值计量的金融工具而言，其当前的风险敞口并非最大风险敞口，随公允价值的变动而变动。

## 2、流动风险

流动性风险，是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司建立了流动性风险管理体系，制定了流动性风险管理相关制度，明确了公司流动性风险管理的组织架构、职责分工、流动性风险的监测、流动性风险的触发条件、报告路线、应急处理方案等。公司一贯坚持资金的统一管理和运作，明确融资管理、现金流管理等由资金运营中心统一负责。公司定期监控流动性覆盖率、净稳定资金率两项监管指标以及备用金、优质流动性资产储备等指标，确保公司维持充裕的优质流动性资产，防范流动性风险。2016年，自有资金管理系统及流动性风险管理系统的上线有效提升了公司流动性风险管理水平。截至2016年12月31日，公司流动性覆盖率、净稳定资金率均符合监管要求，其中，净稳定资金率为117.02%，低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的120%的预警标准。此外，公司还建立了流动性风险应急机制，明确了各级别流动性风险的触发条件及相应的应急计划。

## 3、市场风险

市场风险是指所持有的金融工具的公允价值因市场价格不利变动而发生的风险，包括股票、基金及衍生品等权益类证券价格风险、利率风险、汇率风险等。

公司建立了风险限额体系，主要包括规模限额、止损限额等。董事会确定自营业务年度规模、最大可承受风险限额；执行委员会、投资决策专业委员会确定单个项目的规模、止损限额；证券自营部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、报警线、止损线等进行前端控制；风险管理部通过系统进行实时监控，及时进行风险提示，督促业务部门进行风险处置等。

公司还建立了压力测试机制，分析持仓头寸在极端情景冲击下的可能损失状况，这些极端情景包括：宏观经济衰退、证券市场价格及利率大幅不利变动、特殊风险事件的发生等。压力测试是公司市场风险管理中的重要组成部分，通过压力测试，可以更为突出地显示本公司在压力情境下的可能损失，用于衡量本公司整体的市场风险状态是否在预期范围之内。

### 3.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性资产的公允价值因市场利率不利变动而发生损失的风险。公司持有的具有利率敏感性的债券组合因市场利率不利变动导致公允价值变动的风险是公司利率风险的主要来源。

公司对债券投资组合利率风险的控制，主要采用规模和久期控制等方法，合理配置资产，并通过定期测算投资组合久期、基点价值(DV01)等指标衡量利率风险。

### 3.2 汇率风险

在汇率风险方面，公司持有的外币资产及负债占整体的资产及负债比重并不大；在公司收入结构中，绝大部分赚取收入的业务均以人民币进行交易。公司外币资产及负债均为外币经纪业务，不涉及交易和投资业务。公司通过降低外币资金的净额来降低汇率风险。

### 3.3 权益类证券资产价格风险

权益类证券资产价格风险主要指公司所投资证券的市场价值发生变化而带来损失的风险。权益类证券资产价格风险包括自营业务投资股票、基金、衍生产品等涉及的证券价格风险。

在权益类证券投资方面，公司采用了规模限额和止损限额等风险管理措施，根据市场情况合理控制规模 and 风险敞口。公司还通过VaR等方式对正常波动情况下的短期可能损失进行衡量和分析；通过压力测试对于极端情况下的可能损失进行评估。但是，这些管理工具、方法的使用仍然受到投资策略、风险对冲策略有效性的影响。此外，管理工具、方法的有效性在市场流动性发生负面变化也会受到制约。

## 4、操作风险

操作风险通常包括因内部人为操作失误、内部流程不完善、信息系统故障或不完善等原因而导致的风险，也包括外部发生欺诈行为给本公司造成损失的风险。尽管公司根据中国证监会《证券公司内部控制指引》等规定，制定了较为完善的内部控制制度，但仍不能保证完全避免因操作差错和主观不作为可能带来的经济损失、法律纠纷和违规风险。

信息技术风险是操作风险的一个主要组成部分，信息技术对于证券交易、清算和服务等多个方面的业务发展和管理至关重要，系统不可靠、网络技术不完善、数据误差都会造成公司的损失。此外，公司所处的证券行业是一个智力密集型行业，员工道德风险相对其他行业来说更加突出，员工发生道德犯罪，将会给公司资产造成损失，对声誉造成不利影响。公司将坚持不断健全内部控制管理机制，完善操作流程，强化问责制，加强职业操守和职业道德教育，减少操作风险发生的可能性及其不利影响。

## 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

公司根据《公司法》、《证券法》、《金融企业财务规则》等法律法规及《公司章程》的有关规定，本着公司可持续发展和回报股东相结合的原则制定现金分红政策。公司缴纳所得税后的利润按照《公司章程》规定的分配顺序提取一般风险准备金、法定公积金、交易风险准备金，按照中国证监会有关规定扣除公允价值变动影响额，并确保利润分配方案实施后，公司净资产等风险控制指标不低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的预警标准的前提下，方可向全体股东进行分配。公司于 2012 年 8 月 23 日召开的 2012 年第一次临时股东大会审议通过了《关于修订公司章程的议案》，修订公司章程关于现金分红政策的相关条款。

公司 2015 年度利润分配执行情况：公司于 2016 年 5 月 20 日召开的 2015 年年度股东大会审议通过 2015 年度利润分配方案，以公司截至 2015 年末总股本 8,232,101,395 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 0.90 元(含税)，共计派发现金红利 740,889,125.55 元。公司 2015 年度利润分配方案已于 2016 年 7 月 20 日实施完毕。

#### (二) 公司近三年(含报告期)的普通股股利分配方案或预案、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普通股股东的净利润 | 占合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润的比率(%) |
|--------|---------------|------------------|--------------|----------------|---------------------------|------------------------------|
| 2016 年 | —             | —                | —            | —              | 2,569,336,882.57          | —                            |
| 2015 年 | —             | 0.90             | —            | 740,889,125.55 | 4,064,211,991.64          | 18.23                        |
| 2014 年 | —             | —                | —            | —              | 1,796,097,769.62          | —                            |

#### (三) 以现金方式要约回购股份计入现金分红的情况

适用 不适用

(四) 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方案预案的，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

| 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方案预案的原因  | 未分配利润的用途和使用计划  |
|---|----------------|
| 截至 2016 年 12 月 31 日，公司净稳定资金率为 117.02%；截至 2017 年 2 月末，公司净稳定资金率为 118.92%，均低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的 120%的预警标准。根据公司章程第二百三十五条的相关规定“公司可供分配利润中向股东进行现金分配的部分必须符合相关法律法规的要求，并确保利润分配方案实施后，公司净资产等风险控制指标不低于《证券公司风险控制指标管理办法》规定的预警标准”。为保证公司持续稳定发展，公司拟定 2016 年度不进行现金分红，不送红股，也不进行资本公积转增股本。 | 未分配利润将用于补充净资本。 |

### 二、承诺事项履行情况

| 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 | 如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因 | 如未能及时履行应说明下一步计划 |
|--------------|--------|------------|--|---------------------|---------|----------|----------------------|-----------------|
| 与重大资产重组相关的承诺 | 股份限售   | 北京政泉控股有限公司 | 1、承诺在本公司发行股份购买民族证券 100%股权的重大资产重组中取得的公司股票自发行结束之日起 36 个月内不对外转让；2、承诺于 2013 年 6 月 13 日买入的 29,400 股公司股票与重大资产重组中取得的新增发行股票一并履行法定限售义务。   | 承诺期限 2017 年 8 月 8 日 | 是       | 是        | 不适用                  | 不适用             |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 北京大学       | 1、在本单位根据中国法律、法规和规范性文件的规定被视为股份公司的实际控制人的任何期限内，本单位及本单位控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的业务，如股份公司（包括下属控股企业）有意进一步拓展并实际从事新业务，本单位不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务，本单位并承诺确保本单位所控制企业不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务；<br>2、本单位承诺在经营活动中，不会利用对股份公司的实际控制人地位，从事任何有损于股份公司或其他股东利益的行为，并将充分尊重和保证股份公司（包括下属控股企业）的独立经营、自主决策；<br>3、在本单位作为股份公司实际控制人期间，原则上不再新设立从事与股份公司有相同业务或有同业竞争关系的企业；<br>4、如果出现股份公司的业务与本单位直接或间接控制的其他企业同业竞争的情况，股份公司将较本单位直接或间接控制的其他企业在同等条件下享有优先权。                                    | 长期有效                | 否       | 是        | 不适用                  | 不适用             |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 北大资产经营有限公司 | 1、在本公司根据中国法律、法规和规范性文件的规定被视为股份公司的控股股东北大方正集团有限公司的任何期限内，本公司及本公司控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的业务，如股份公司（包括下属控股企业）有意进一步拓展并实际从事新业务，本公司不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务，本公司并承诺确保本公司所控制企业不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务；<br>2、本公司承诺在经营活动中，不会利用对股份公司的控股股东北大方正集团有限公司的控股地位，从事任何有损于股份公司或其他股东利益的行为，并将充分尊重和保证股份公司（包括下属控股企业）的独立经营、自主决策；<br>3、在本公司作为股份公司控股股东北大方正集团有限公司的控股股东期间，原则上不再新设立从事与股份公司有相同业务或有同业竞争关系的企业；<br>4、如果出现股份公司的业务与本公司直接或间接控制的其他企业同业竞争的情况，股份公司将较本公司直接或间接控制的其他企业在同等条件下享有优先权。 | 长期有效                | 否       | 是        | 不适用                  | 不适用             |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 北大方正集团有限公司 | 1、在本公司合法持有股份公司股份的任何期限内，本公司及本公司控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的业务，如股份公司（包括下属控股企业）有意进一步拓展并实际从事新业务，  | 长期有效                | 否       | 是        | 不适用                  | 不适用             |

|              |        |            |  |         |   |   |     |     |
|--------------|--------|------------|--|---------|---|---|-----|-----|
|              |        |            | <p>本公司不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务，本公司并承诺确保本公司所控制企业不会从事与股份公司（包括下属控股企业）相竞争的该等新业务；</p> <p>2、本公司承诺在经营活动中，不会利用对股份公司的控股股东控股地位，从事任何有损于股份公司或其他股东利益的行为，并将充分尊重和保证股份公司（包括下属控股企业）的独立经营、自主决策；</p> <p>3、在本公司作为股份公司控股股东期间，原则上不再新设立从事与股份公司有相同业务或有同业竞争关系的企业；</p> <p>4、如果出现股份公司的业务与本公司直接或间接控制的其他企业同业竞争的情况，股份公司将较本公司直接或间接控制的其他企业在同等条件下享有优先权；</p> <p>5、本公司将充分尊重股份公司的独立法人地位，保障股份公司独立经营、自主决策。本公司将严格按照中国《公司法》以及股份公司的《公司章程》规定，促使本公司提名的股份公司董事依法履行其应尽的的诚信和勤勉责任。</p> |         |   |   |     |     |
| 与重大资产重组相关的承诺 | 解决同业竞争 | 方正证券股份有限公司 | 承诺在本公司发行股份购买民族证券 100%股权的重大资产重组完成后 5 年内解决民族证券与本公司、本公司控股子公司瑞信方正证券有限责任公司之间的同业竞争。  | 有效期 5 年 | 是 | 是 | 不适用 | 不适用 |
| 与重大资产重组相关的承诺 | 解决同业竞争 | 北京政泉控股有限公司 | 只要政泉控股直接或间接对上市公司产生重大影响，政泉控股及政泉控股的参、控股公司或政泉控股拥有实际控制权或重大影响的其他公司将不会从事任何与上市公司目前或未来所从事的业务发生或可能发生竞争的业务；如政泉控股及政泉控股的参、控股公司或政泉控股拥有实际控制权或重大影响的其他公司现有经营活动可能在将来与上市公司发生同业竞争或与上市公司发生利益冲突，政泉控股将放弃或将促使政泉控股之参、控股公司或政泉控股拥有实际控制权或重大影响的其他公司无条件放弃可能发生同业竞争的业务。   | 长期有效    | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决关联交易 | 北京大学       | 在本校实际控制方正证券股份有限公司股份的任何期限内，本校及本校所控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）将尽最大努力减少或避免与方正证券股份有限公司的关联交易；对于无法避免的关联交易，将本着公平、公开、公正的原则确定交易价格，保证关联交易的公允性。   | 长期有效    | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决关联交易 | 北大资产经营有限公司 | 在本公司间接持有方正证券股份有限公司股份的任何期限内，本公司及本公司所控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）将尽最大努力减少或避免与方正证券股份有限公司的关联交易；对于无法避免的关联交易，将本着公平、公开、公正的原则确定交易价格，保证关联交易的公允性。  | 长期有效    | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决关联交易 | 北大方正集团有限公司 | 在本公司合法持有方正证券股份有限公司股份的任何期限内，本公司及本公司所控制的企业（包括但不限于独资经营、合资经营、合作经营以及直接或间接拥有权益的其他公司或企业）将尽最大努力减少或避免与方正证券股份有限公司的关联交易；对于无法避免的关联交易，将本着公平、公开、公正的原则确定交易价格，保证关联交易的公允性。  | 长期有效    | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |

|              |          |            |   |      |   |   |     |     |
|--------------|----------|------------|---|------|---|---|-----|-----|
| 与重大资产重组相关的承诺 | 解决关联交易   | 北京政泉控股有限公司 | <p>政泉控股及政泉控股的参、控股公司或政泉控股拥有实际控制权或重大影响的其他公司不会利用拥有的上市公司股东权利或者实际控制能力操纵、指使上市公司或者上市公司董事、监事、高级管理人员，使得上市公司以不公平的条件，提供或者接受资金、商品、服务或者其他资产，或从事任何损害上市公司利益的行为。</p> <p>政泉控股及政泉控股的参、控股公司或政泉控股拥有实际控制权或重大影响的其他公司与上市公司进行关联交易均将遵循平等、自愿、等价、有偿的原则，保证交易公平、公允，维护上市公司的合法权益，并根据法律、行政法规、中国证监会及证券交易所的有关规定和公司章程，履行相应的审议程序并及时予以披露。</p>  | 长期有效 | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |
| 与重大资产重组相关的承诺 | 民族证券资产完整 | 北京政泉控股有限公司 | <p>1、关于民族证券及营业部部分房屋未取得土地使用权证问题的承诺：民族证券乐山大桥证券营业部位于成都的 1 处房产（房产证号为：蓉房权证成房监证字第 1042134 号）所占用的土地使用权证书正在办理过程中。就上述情况，政泉控股承诺：如因未取得上述用地的土地使用权证书导致未来该等土地无法继续使用，或地上房产的处置权利、市场价值以及民族证券或方正证券的正常经营活动受到不利影响，并给民族证券或方正证券造成损失的，政泉控股将以现金方式全额赔偿； 2、关于民族证券呼和浩特新华东街证券营业部车库未取得产权证书问题的承诺：民族证券呼和浩特新华东街证券营业部的一个车库尚未取得任何产权证书。就上述情况，政泉控股承诺：如因未取得产权证书的瑕疵导致民族证券或方正证券未来无法继续使用上述车库，影响民族证券或方正证券正常经营或使其遭受其他损失，政泉控股将以现金方式全额赔偿； 3、关于民族证券及营业部租赁物业权属不清晰问题的承诺：民族证券及营业部共有 8 项租赁的经营用房未能提供出租方的产权证明或产权人授权其出租的证明文件。就上述情况，政泉控股承诺：如未来因上述原因导致民族证券或方正证券无法继续使用上述房屋，影响民族证券或方正证券正常经营或使其遭受其他损失，政泉控股将以现金方式全额赔偿； 4、关于民族证券及营业部租赁物业备案瑕疵的确认和承诺：民族证券及营业部承租的 57 处房产中共有 56 项未办理租赁备案手续，对外出租的 13 处房产皆未办理租赁备案手续。就上述情况，政泉控股承诺：如因上述房屋未办理租赁登记备案手续导致民族证券被处罚或遭受其他经济损失，政泉控股将以现金方式全额赔偿； 5、关于民族证券部分交易性金融资产尚未过户的确认和承诺：民族证券交易性金融资产中包含退市公司湖北洪湖生态农业股份有限公司（全国中小企业股份转让系统股票简称“生态 1”，代码 400027）的股票 124.3 万股，市值为 2,300,382.50 元；退市公司黑龙江省科利华网络股份有限公司（全国中小企业股份转让系统股票简称“龙科 1”，代码 400048）的股票 21 万股，市值为 426,300.00 元。前述两支股票为民族证券在对以往经营资产清理和追讨过程中应得的资产，但目前未登记在民族证券名下。就上述情况，政泉控股承诺：如上述交易性金融资产无法过户至民族证券名下导致民族证券受到损失，政泉控股将以现金方式全额赔偿。</p> | 长期有效 | 否 | 是 | 不适用 | 不适用 |

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、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明

适用 不适用

五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明

适用 不适用

六、聘任、解聘会计师事务所情况

|               | 现聘任              |
|---------------|------------------|
| 聘任、解聘会计师事务所情况 | 天健会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境内会计师事务所报酬    | 不超过 120 万元       |
| 境内会计师事务所审计年限  | 8 年              |

|              | 名称               | 报酬        |
|--------------|------------------|-----------|
| 内部控制审计会计师事务所 | 天健会计师事务所（特殊普通合伙） | 不超过 25 万元 |

公司续聘天健会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司 2016 年年度审计机构。天健会计师事务所（特殊普通合伙）自 2008 年起，已经连续八年为本公司提供年度审计服务。

七、面临暂停上市风险的情况

适用 不适用

八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

九、破产重整相关事项

适用 不适用

十、重大诉讼、仲裁事项

（一）本年度公司无重大诉讼、仲裁事项，其他诉讼、仲裁事项具体如下：

1、山东东营中拓诉公司合同纠纷案

2016 年 3 月 3 日，东营中拓投资有限责任公司向长沙天心区人民法院提起诉讼，以山东省高级人民法院[（2015）鲁商终字第 255 号]民事判决书已确认“2007 年 5 月 11 日泰阳证券与东营中拓签订的《协议书》无效”为由，请求法院判令公司返还基于前述《协议书》取得的款项 13,016,711 元，并承担本案诉讼费用。

公司向最高人民法院申请启动本案关键证据——山东省高级人民法院[（2015）鲁商终字第 255 号]案件的再审程序，最高人民法院于 2016 年 7 月 7 日受理并立案。公司已向长沙市天心区人民法院提交中止审理申请书，申请中止审理本案。2016 年 12 月，最高人民法院驳回再审申请，长沙市天心区人民法院恢复审理，本案一审于 2017 年 1 月 13 日开庭；2017 年 3 月 15 日，公司收到天心区人民法院一审判决，判决公司应在判决书生效起 15 日内向东营中拓公司返还 13,016,711.05 元。

2、民族证券诉四川圣达债券交易合同纠纷

民族证券有限责任公司投资部（原固定收益部）于 2013 年 3 月 26 日、2014 年 4 月 2 日分别买入 5,000 万、3,000 万“12 圣达债”，合计持仓数量 800,000 张。2015 年 12 月 5 日发行人四川圣达集团有限公司由于未能按期支付利息及兑付回售债券本金。民族证券与其他债券持有人共同发起追偿工作。四川省高级人民法院于 2016 年 06 月 07 日受理本案。2016 年 8 月法院开庭审理本案，并组织各方进行调解。

根据四川圣达集团有限公司提出的和解方案，债券受托管理人天津银行股份有限公司成都分行于 2017 年 1 月 13 日召集召开了债券持有人会议，审议通过了《关于天津银行股份有限公司成都分行签署〈和解协议书〉的议案》，根据天津银行股份有限公司成都分行与四川圣达集团有限公司签订了和解协议书的约定，四川圣达集团有限公司通过处置所持四川圣达水电开发有限公司 7,800 万股股权，以及其所持的长城国际动漫游戏股份有限公司 1,000 万股流通 A 股，将处置所得的全部所得款项偿还本案债券本金及利息（按本金和利息的比例清偿）。根据和解协议书，民族证券持有的 8,000 万元 12 圣达债按比例可偿付 6,718.4 万元。

民族证券正督促四川圣达集团有限公司按照和解协议书处置资产，并于 2017 年 2 月 9 日向法院递交了执行申请书，现等待进入执行程序。

### 3、中国农业银行辽宁省分行诉民族证券合同纠纷

2000 年 5 月，中国农业银行辽宁省分行因与中国民族国际信托投资公司拆借合同纠纷诉至沈阳市沈河区人民法院，双方达成调解，由民族信托偿还农行 380 万美元及相应利息，但中国民族国际信托投资公司一直未能偿还。2016 年 9 月 8 日，民族证券收到辽宁省高级人民法院送达的起诉状，辽宁省分行以中国民族国际信托投资公司执行程序中不履行义务，转移其优质资产于 2001 年以其证券营业部和证券资产出资，与他人共同设立民族证券，符合《最高人民法院关于审理与企业改制相关的民事纠纷案件若干问题的规定》第七条的规定为由。将民族证券作为被告，中国民族国际信托投资公司为第三人，向法院起诉要求民族证券支付本息共计 14,071.7612 万元（其中本金 2,572.76 万元，利息 11,499.0012 万元），以及承担诉讼费 15 万元。

本案于 2016 年 12 月 7 日第一次开庭，庭审结束后，民族证券向辽宁省高级人民法院提交了调取案件相关证据的申请，2017 年 2 月 7 日法院组织进行了本案第二次开庭，截至本报告披露日尚未判决。

该案件历史情况如下：

2000 年 6 月 22 日，“中央党政机关金融类企业脱钩工作小组”批准中国民族国际信托投资公司整体转制为证券公司。但由于种种原因，“整体转制”方案无法操作，2002 年 4 月 12 日，中国证监会批复民族信托以证券类净资产 44,895.64 万元，联合其他股东共同出资设立中国民族证券有限责任公司。2002 年 8 月 16 日，中国人民银行批复中国民族国际信托投资公司办理经营范围变更，在规定期限内完成清理工作。

2003 年 11 月 27 日，沈阳市沈河区法院做出（2001）沈河执字第 1237 号《民事裁定书》，裁定由民族证券偿还中国民族国际信托投资公司所欠农行辽宁省分行债务。

2013 年 4 月 19 日，沈阳市沈河区法院根据《最高人民法院关于审理与企业改制相关的民事纠纷案件若干问题的规定》第七条“企业以其优质财产与他人组建新公司，而将债务留在原企业，债权人以新设公司和原企业作为共同被告提起诉讼主张债权的，新设公司应当在所接收的财产范围内与原企业共同承担连带责任”的规定，做出（2001）沈河执字第 1237 号-3《民事裁定书》，裁定：一、撤销 2003 年 11 月 27 日的（2001）沈河执字第 1237 号《民事裁定书》；二、追加民族证券为被执行人，在民族证券接受财产范围内就被执行人中国民族国际信托投资公司未清偿的债务向农行辽宁省分行进行清偿。

经民族证券提出执行异议，沈阳市沈河区法院于 2013 年 9 月 30 日做出裁定撤销沈河区法院做出（2001）沈河执字第 1237 号-3《民事裁定书》的第二项内容，农行辽宁省分行不服该裁定向沈阳市中院申请复议，沈阳市中院于 2014 年 7 月 9 日裁定驳回复议。

#### 4、航天科工资产管理有限公司诉公司及固体火箭债权转让纠纷案

2008 年 2 月，火箭公司因与原泰阳证券有限责任公司委托理财纠纷，向湖南省高级人民法院提起诉讼，要求原泰阳证券赔偿其委托理财本金、其他款项及利息共计 2.4 亿多元。2008 年 3 月 25 日，湖南省高级人民法院以“本案与原告（火箭公司）总经理陈军及被告（原泰阳证券）原总裁李选明等人涉嫌操纵证券交易价格罪有关联”为由，作出（2008）湘高法民二初字第 2-1 号民事裁定书，依法裁定中止审理本案。2012 年 3 月 14 日，湖南省高级人民法院作出书面通知，通知该案已移送湖南省公安厅经济犯罪侦查总队处理，至此民事诉讼程序终结。

2012 年 10 月 31 日，火箭公司与航天科工资产管理有限公司（以下简称“航天资管公司”）签订《债权转让协议》，将前述委托理财案所涉的债权 23,888.57 万元及 2 亿元本金自 2002 年 1 月 10 日起的同期银行贷款利息 12,448 万元（暂计至 2012 年 10 月 31 日）转让给航天资管公司。2013 年 7 月，航天资管公司以在《债权转让协议》生效 60 日内未能收回债权为由，向北京市第一中级人民法院（下称“北京第一中院”）提起诉讼，要求火箭公司支付前述本金及利息；2013 年 8 月，航天资管公司向北京第一中院申请追加公司为第一被告，请求判决公司向航天资管公司偿还 23,888.57 万元及 2 亿元本金自 2003 年 1 月 1 日起的同期银行贷款利息 12,342.40 万元（按五年同期贷款利率 5.76% 计算，暂计至 2013 年 7 月 24 日），并要求第二被告火箭公司对上述债务承担连带保证责任。2013 年 8 月和 11 月，公司分别向北京第一中院、北京市高级人民法院提交了管辖权异议申请书及管辖权异议上诉状。2014 年 1 月 14 日，北京市高级人民法院作出（2013）高民终字第 4353 号民事裁定书，裁定驳回上诉，维持“北京第一中院驳回公司对本案提出的管辖权异议”的原裁定。后公司向最高人民法院申请再审。2014 年 8 月 19 日，最高人民法院再审裁定认为：一、二审法院根据《资产委托管理协议》中对保证本息固定回报条款的约定，认为双方实为借款合同关系，并据此确定案件的地域管辖并无不当；但本案诉讼标的额在 2 亿元以上，应由北京市高级人民法院管辖。

2015 年 1 月 26 日，航天资管公司以债权转让纠纷为由向北京市高级人民法院提起诉讼，起诉公司（第一被告）和火箭公司（第二被告），要求公司偿还 238,885,700 元，及 2 亿元本金自 2003 年 1 月 1 日起的同期银行贷款利息（五年同期贷款利率 5.76%），暂计至 2013 年 7 月 24 日为 123,424,000 元；火箭公司对上述债务承担连带保证责任；公司承担本案诉讼费用。

北京市高级人民法院于 2015 年 8 月 7 日作出【（2015）高民（高）初字第 788 号】民事判决书，判令公司向航天科工资产管理有限公司、航天固体运载火箭有限公司返还理财本金 238,885,700 元及 2006 年 1 月 1 日起至给付之日止的同期银行贷款利息。我公司不服一审判决向最高人民法院提起上诉，最高人民法院于 2015 年 12 月 2 日开庭审理本案，截至本报告披露日本案尚未判决。

#### 5、政泉控股诉公司决议效力确认纠纷案件

公司于 2015 年 5 月 14 日收到北京市西城区人民法院民事传票【2015 年西民（商）初字第 14085 号】，公司股东北京政泉控股有限公司（以下简称“政泉控股”）以公司决议效力确认纠纷为由对本公司提起诉讼。请求北京市西城区人民法院受理该案并暂定于 2015 年 6 月 3 日开庭审理。请求法院判令确认本公司于 2015 年 3 月 12 日作出的公告编号为 2015-038 的《方正证券股份有限公司第二届董事会第十六次会议决议》中《关于选举董事长的议案》的内容无效；2、请求判令由本公司承担本案全部诉讼费。

在提交答辩状期间，公司向北京市西城区人民法院提交《管辖权异议申请书》及相关证据，2015 年 6 月 10 日，公司收到西城区人民法院民事裁定书【（2015）西民（商）初字第 14085 号】，裁定本案移送湖南省长沙市天心区人民法院管辖。

长沙市天心区法院于 2016 年 4 月 28 日开庭审理本案，截至本报告披露日本案尚未判决。

#### 6、刘冬成诉方正证券昆明三市街营业部消费者权益保护纠纷

公司昆明三市街营业部客户刘冬成融资买入分级基金 B 后，因分级基金 B 下折，导致信用账户维持担保比例不足 130%被强制平仓产生纠纷，于 2015 年 12 月 3 日向昆明市中级人民法院提起消费者权益保护纠纷之诉，要求营业部支付其分级基金 B 购售差和赔偿共计人民币 35,075,386 元，以及利息 813,554 元。公司向昆明市中级人民法院提交管辖权异议申请后法院驳回了管辖异议申请，本案现处于昆明市中级人民法院审理过程中。

#### 7、刘冬成诉方正证券昆明三市街营业部融资融券合同纠纷

公司昆明三市街营业部客户刘冬成融资买入分级基金 B 后，因分级基金 B 下折，导致信用账户维持担保比例不足 130%被强制平仓产生纠纷，于 2015 年 12 月 3 日向昆明市中级人民法院提起委托合同纠纷之诉，要求营业部返还平仓股票（按起诉当日市值计算为 6,491,073 元），并赔偿其 18,058,236 元以及利息 508,791 元。方正证券于 2015 年 12 月 31 日向昆明市中级人民法院提起管辖权异议申请，该案现已裁定移送长沙市天心区人民法院管辖。2016 年 6 月 7 日，刘冬成就本案向长沙市天心区人民法院提交变更后的起诉状，将本案案由变更为融资融券合同纠纷，并将

诉讼请求变更为要求方正证券赔偿 2,587.4916 万元。本案现已审理终结，一审判决驳回对方诉讼请求，截至本报告披露日该案处于上诉期间，一审判决尚未生效。

## （二）公司本年度被处罚和公开谴责的情况

1、2016 年 11 月 28 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]129 号），因公司存在未按规定审查、了解客户真实身份违法违规，对方正证券责令改正，给予警告，没收违法所得 7,862,735.62 元，并处以 15,725,471.24 元罚款。详见公司于 2016 年 11 月 29 日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》。

2、公司于 2015 年 7 月 15 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站刊登《关于收到中国证监会调查通知书的公告》（公告编号：2015-080），因涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规，公司被中国证监会立案调查。2016 年 12 月 19 日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2016]106 号），中国证监会拟对公司及相关责任主体做出相关行政处罚，具体处罚如下：对方正证券责令改正，给予警告，并处以 60 万元罚款。详见公司于 2016 年 12 月 20 日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》。

## 十一、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

1、公司处罚及整改情况详见本章“公司本年度被处罚和公开谴责的情况”。

2、2016 年 6 月，方正集团因涉嫌违反证券法律法规被中国证监会立案调查。截至本报告披露日，方正集团尚未收到调查结果。

3、2016 年 12 月 19 日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2016]106 号），因本公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规，中国证监会拟对方正集团做出相关行政处罚如下：对方正集团责令改正，给予警告，并处以 60 万元罚款。详见公司于 2016 年 12 月 20 日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》。截至本报告披露日，方正集团尚未收到行政处罚决定。

4、2016 年 12 月 20 日，方正科技收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2016]104 号），因方正科技未按照规定披露关联关系及关联交易，中国证监会拟对方正集团做出如下处罚：对方正集团责令改正，给予警告，并分别处以 60 万元罚款。截至本报告披露日，方正集团尚未收到行政处罚决定。

## 十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

报告期内，公司及其控股股东、实际控制人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。

十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

适用 不适用

十四、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

| 事项概述   | 查询索引  |
|--|---|
| 公司于2016年4月28日召开第二届董事会第二十七次会议审议通过《关于签署日常关联交易框架协议暨确认2015年度日常关联交易金额及预计2016年日常关联交易金额的议案》，预计2016年度日常关联交易金额合计13,910万元，其中采购计算机硬件与软件金额5,300万元，提供及接受证券和金融服务金额7,710万元，其他日常关联交易900万元。 | 具体情况详见公司于2016年4月29日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十七次会议决议公告》、《日常关联交易公告》；报告期内日常关联交易的执行情况详见本报告第十一节“财务报告”之“会计报表附注”第七项“关联方及关联交易”。 |

3、临时公告未披露的事项

本公司关联法人上海京慧诚国际贸易有限公司（简称“上海京慧诚”）、北大方正集团财务有限公司（简称“北大方正财务”）与北京航翔广告有限公司签署了《广告发布合同》，拥有首都机场T3航站楼捷运快车的相关广告发布权。2016年10月，本公司与北京航翔广告有限公司、上海京慧诚、北大方正财务签署了《合同权利义务转让协议书》，上海京慧诚、北大方正财务将首都机场T3航站楼捷运快车的相关广告发布权及《广告发布合同》约定的相关权力义务转让给本公司，期限一年，关联交易金额2,852.32万元。

根据董事会的授权，上述关联交易由公司执行委员会审批。

单位：万元 币种：人民币

| 关联交易方       | 关联关系     | 关联交易类型 | 关联交易内容   | 关联交易定价原则 | 关联交易价格  | 关联交易金额   | 占同类交易金额的比例(%) | 关联交易结算方式 | 市场价格     | 交易价格与市场价格差异较大的原因 |
|-------------|----------|--------|----------|----------|---|----------|---------------|----------|----------|------------------|
| 上海京慧诚       | 控股股东的子公司 | 其他流出   | 广告发布权及义务 | 市场化原则    | 无   | 2,252.32 | 44.52         | 现金       | 2,252.32 | 不适用              |
| 北大方正财务      | 控股股东的子公司 | 其他流出   | 广告发布权及义务 | 市场化原则    | 无   | 600.00   | 11.86         | 现金       | 600.00   | 不适用              |
| 合计          |          |        |          |          | -   | 2,852.32 | -             | -        | 2,852.32 | -                |
| 大额销货退回的详细情况 |          |        |          |          | 不适用   |          |               |          |          |                  |
| 关联交易的说明     |          |        |          |          | 首都机场T3航站楼捷运快车是优质的广告载体，公司受让该广告发布权，有利于推广公司品牌，提升公司知名度。上述关联交易按照市场价格进行，不存在损害其他股东，尤其是中小股东利益的情形。<br>上述关联交易不会对公司的独立性产生不良影响。 |          |               |          |          |                  |

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

适用 不适用

### (三) 共同对外投资的重大关联交易

适用 不适用

### 十五、重大合同及其履行情况

适用 不适用

### 十六、其他重大事项的说明

1、2016 年新增借款情况。2016 年度，公司累计新增融资 2,511.23 亿元，其中通过发行短期公司债券、次级债券融资 190 亿元，通过收益凭证、两融资产收益权转让及转融资等方式融资 2,321.23 亿元。2016 年新增融资超过上年末净资产的 20%，属于《上海证券交易所非公开发行公司债券业务管理暂行办法》第 4.9 条规定之重大事项。公司融资规模增加主要由于公司业务规模发展迅速，资金需求不断增加。新增负债不会对公司经营情况和整体偿债能力造成实质性不利影响。

2、2016 年 2 月 1 日，公司第二届董事会第二十六次会议审议通过了《关于方正中期期货有限公司改制并挂牌的议案》，同意方正中期由有限责任公司整体变更为股份有限公司，并申请在新三板挂牌并公开转让。详见公司于 2016 年 2 月 2 日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十六次会议决议公告》。截至本报告披露日，该事项暂无进展。

3、2016 年 2 月 1 日，因工作需要，公司合规总监孙斌先生不再兼任首席风险官、副总裁赵亚男女士不再担任财务负责人，公司第二届董事会第二十六次会议决定聘任陈飞先生为首席风险官、卫剑波先生为财务负责人。详见公司于 2016 年 2 月 2 日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十六次会议决议公告》。

4、2016 年 2 月 19 日，公司 2016 年第一次临时股东大会决定解除赵大建先生董事职务、杨克森女士监事职务，并补选车莉丽女士为第二届董事会董事、徐建伟先生为第二届监事会监事。详见公司于 2016 年 2 月 20 日在指定信息披露媒体刊登的《2016 年第一次临时股东大会决议公告》。

5、截至本报告披露日，公司全资子公司方正和生投资有限责任公司累计出售其所持有的东兴证券股份有限公司（证券代码：601198）股票 5,400 万股。本次交易将增加本公司 2016 年度合并报表净利润约 108,614 万元。详见公司于 2016 年 4 月 1 日、4 月 7 日、4 月 13 日、4 月 16 日、4 月 28 日在指定信息披露媒体刊登的《关于子公司处置可供出售金融资产的公告》。

6、2016 年 4 月 28 日，经公司第二届董事会第二十七次会议审议，公司增补高利先生、吴珂先生为执行委员会委员；赵亚男不再担任公司副总裁。详见公司于 2016 年 4 月 29 日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十七次会议决议公告》。

7、民族证券 20.5 亿元款项情况。截至本公告日，该 20.5 亿元款项共转回 411,037,181.24 元，其中本金转回 308,500,000 元，还剩余 17.415 亿元本金尚未收回。公司将持续关注民族证券 20.5 亿元款项相关进展并督促民族证券努力追回款项本金及投资收益，及时履行信息披露义务。详见公司于 1 月 12 日、5 月 27 日、5 月 31 日在指定信息披露媒体刊登《关于民族证券 20.5 亿元款项调查情况的进展公告》。

8、2016年7月5日，经公司第二届董事会第二十八次会议审议，公司聘任姜志军先生为公司副总裁。详见公司于2016年7月5日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十八次会议决议公告》。

9、2016年8月29日，经公司第二届董事会第二十九次会议审议，通过了《关于撤销北京证券自营分公司的议案》，同意撤销北京证券自营分公司，将原自营分公司下各部门设立为母公司一级部门，并授权执行委员会办理具体事宜。详见公司于2016年8月30日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十九次会议决议公告》。截至本报告披露日，公司正在办理北京证券自营分公司的撤销事宜。

10、2016年8月29日，经公司第二届董事会第二十九次会议审议，审议通过了《关于增加方正证券（香港）金融控股有限公司注册资本的议案》。同意对方正证券（香港）金控增资不超过4亿港元，并授权执行委员会根据公司实际情况及方正香港业务发展需要分阶段实施本次增资。详见公司于2016年8月30日在指定信息披露媒体刊登的《第二届董事会第二十九次会议决议公告》。截至本报告披露日，公司正在办理方正香港的增资事宜。

11、2016年10月25日，公司收到湖南监管局对公司出具的《关于对方正证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]8号），因公司研究所员工廖蕾2016年4月7日以公司名义通过视频播报方式向投资者推荐中兴通讯股票，该视频在互联网广泛传播，引发市场热议。该视频播报构成《发布证券研究报告暂行规定》第二条所述的证券研究报告发布行为。上述情况违反了《发布证券研究报告暂行规定》第六条、第十条、第十七条的相关规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》第二十二条，湖南监管局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。详见公司于2016年10月25日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证监会湖南监管局警示函的公告》。

12、2016年11月24日，公司2016年第二次临时股东大会换届选举产生第三届董事会全部董事和第三届监事会全部非职工代表监事。新任董事为：高利、廖航、何亚刚、汪辉文、车莉丽、徐昂杨、叶林、李明高、赵旭东，新任非职工代表监事为：雍苹、马楠。详见公司于2016年11月25日在指定信息披露媒体刊登的《2016年度第二次临时股东大会决议公告》。

13、2016年11月28日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]129号），因公司存在未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为，对方正证券责令改正，给予警告，没收违法所得7,862,735.62元，并处以15,725,471.24元罚款。详见公司于2016年11月29日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》。

14、公司于2015年7月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站刊登《关于收到中国证监会调查通知书的公告》（公告编号：2015-080），因涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规，公司被中国证监会立案调查。2016年12月19日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2016]106号），中国证监会拟对公司及相关责任主体做出相关行政处罚，具体处罚如下：一、对方正证券责令改正，给予警告，并处以60万元罚款；二、对何其聪给予警告，并处以30万元罚款；对余丽、郝丽敏、

雷杰给予警告，并分别处以 10 万元罚款；对韦俊民给予警告，并处以 5 万元罚款。详见公司于 2016 年 12 月 20 日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》。

15、公司于 2016 年 11 月 24 日召开的 2016 年第二次临时股东大会修订了公司章程的部分重要条款，修订后的公司章程自监管部门核准之日起生效。2016 年 12 月 21 日，公司收到湖南监管局《关于核准方正证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（湘证监机构字[2016]56 号），该批复核准公司变更公司章程的重要条款。修订后的公司章程自上述批复核准之日起生效。详见公司于 2016 年 12 月 22 日在指定信息披露媒体刊登的《关于获准变更公司章程重要条款的公告》。

16、公司于 2017 年 1 月 4 日收到湖南监管局对公司出具的《行政监管措施决定书》，由于公司部分营业部在 2012—2014 年期间，存在以下违规行为：一是客户佣金管理不规范，佣金调整无客户确认记录；二是在向客户提供证券投资顾问服务并收取服务费用的情况下，未按要求与客户签订证券投资顾问协议，湖南监管局决定对公司采取责令限期改正以及谴责的监管措施。对于上述违规行为，公司在自查发现问题后已及时整改完毕，并在内部加强了合规管理，2014 年之后已杜绝了该类情况的发生，对公司 2016 年度以及以后年度业绩无重大不利影响。详见公司于 2017 年 1 月 5 日在指定信息披露媒体刊登的《关于收到中国证监会湖南监管局行政监管措施决定书的公告》。

17、公司董事会于 2017 年 1 月 9 日收到独立董事胡廷华先生递交的书面辞职申请，胡廷华先生因个人原因申请立即辞去公司独立董事职务。根据《董事会薪酬与考核委员会工作细则》及《董事会提名委员会工作细则》的规定，胡廷华先生辞去独立董事职务后也将不再担任薪酬与考核委员会及提名委员会委员职务。鉴于胡廷华先生的辞职导致公司独立董事人数不足董事会成员总数的三分之一，根据《公司法》、《公司章程》等有关规定，胡廷华先生的辞职将在公司股东大会选举产生新的独立董事后生效。在此之前，胡廷华先生仍将履行公司独立董事的职责。公司董事会将按照相关规定，尽快完成新任独立董事的补选工作。详见公司于 2017 年 1 月 10 日在指定信息披露媒体刊登的《关于独立董事辞职的公告》。

18、公司董事会于 2017 年 1 月 10 日收到董事车莉丽女士递交的书面辞职申请，车莉丽女士因个人原因申请辞去公司董事职务。根据《董事会审计委员会工作细则》的规定，车莉丽女士辞去董事职务后将不再担任董事会审计委员会委员职务。车莉丽女士的辞职不会导致公司董事会成员人数低于法定最低人数，车莉丽女士的辞职即时生效。详见公司于 2017 年 1 月 10 日在指定信息披露媒体刊登的《关于董事辞职的公告》。

19、2017 年 2 月 17 日，公司接到控股股东方正集团通知，方正集团正在筹划与公司有关的重大事项，因该事项目前仍存在不确定性，为保证公平信息披露、维护投资者利益，避免造成股价异常波动，公司股票自 2017 年 2 月 17 日起停牌。公司将按照上海证券交易所的相关规定履行信息披露义务，每 5 个交易日披露相关进展情况。详见 2017 年 2 月 17 日在指定信息披露媒体刊登的《重大事项停牌公告》。2017 年 2 月 22 日，方正集团再次致函本公司，称方正集团及相关各方

正在进行协调磋商，因涉及面较广，该事项目前仍存在不确定性，建议公司股票继续停牌。公司召开第三届董事会第四次会议，审议通过了《关于申请公司股票继续停牌的议案》，经公司申请，公司股票自 2017 年 2 月 24 日起继续停牌。详见 2017 年 2 月 24 日在指定信息披露媒体刊登的《重大事项继续停牌公告》。2017 年 3 月 2 日，方正集团致函本公司，称在停牌期间各方未能就本次交易标的的股权调整方案达成一致，方正集团认为交易条件尚不成熟，决定终止筹划本次重大事项，由公司申请自 2017 年 3 月 3 日起股票复牌。详见 2017 年 3 月 3 日在指定披露媒体刊登的《关于终止筹划重大事项暨股票复牌的公告》。

## 十七、积极履行社会责任的工作情况

### （一）上市公司扶贫工作情况

#### 1、精准扶贫规划

认真贯彻落实习近平总书记系列重要讲话精神，结合方正证券及子公司自身生产经营情况、战略发展规划、人才与资源优势，以“精准扶贫、精准脱贫”为指导，以业务创新为动力，以贫困县需求为导向，整合公司、股东、合作伙伴、各级政府等多方资源，与建档立卡贫困户紧密衔接，搭建“以产业、金融扶贫为点，以教育、消费、公益扶贫为面”的扶贫工作体系，坚持真扶贫、扶真贫，主动承担公众公司社会责任，为全面建成小康社会贡献力量。

方正证券及子公司通过与国家级贫困县签订扶贫战略合作协议、组建金融扶贫工作站等方式确定结对帮扶贫困县，与当地建立长效帮扶机制，紧紧围绕“精准扶贫、精准脱贫”的指导思想，因地制宜，立足于贫困县资源禀赋和经济社会发展目标，依托当地发展规划和脱贫计划开展专业帮扶，精准对接当地的金融需求，帮助县域内企业规范公司治理，提高贫困地区利用资本市场促进经济发展的能力，不断增强贫困地区自我发展能力，为贫困县打赢扶贫攻坚战提供服务和支撑。

#### 2、年度精准扶贫概要

方正证券及子公司民族证券、方正中期、方正富邦等积极履行社会责任，响应党中央、国务院和中国证监会的号召，积极开展“一司一县”精准扶贫工作。根据公司扶贫规划，2016 年方正证券及子公司按计划完成了年度扶贫工作任务。

**2.1 签定扶贫协议** 报告期内，公司共承担（或参与）了跨越 5 省（自治区），涉及 5 个国家级贫困县（地区）的精准扶贫任务。与湖南省安化县、江西省石城县、宁夏回族自治区隆德县、河南省新县签订了扶贫战略合作协议，参与新疆维吾尔自治区喀什地区棉农的保价服务试点工作。

**2.2 加强组织领导** 2016 年 10 月，经公司执行委员会审议通过，方正证券及子公司分别成立扶贫工作领导小组，全面负责公司扶贫相关工作。12 月 26 日，成立扶贫工作部，全面协调开展扶贫工作。陆续选派 4 位挂职干部，负责结对帮扶县扶贫工作的落实。在贫困县设立金融扶贫工作站，负责所在贫困县县域资本市场培训及投资者教育等工作。

**2.3 深耕产业扶贫** 2016 年，公司支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，承揽、承做多个注册地为国家级贫困县的企业项目，包括新三板挂牌项目 6 个，新三板融资项目 1 个；子公司民族证券承做首次公开发行股票项目 1 个，新三板挂牌项目 1 个，并购重组业务 2 个。

**2.4 做细金融扶贫** 公司在国家级贫困县共设立营业部 25 个，接收当地人口就业数量为 194 人。2016 年，共举办包括总部大型投资报告会、营业部投资报告会、营业部投资顾问培训、两融业务培训、期权业务培训、港股通知识培训等资本市场教育培训 95 次，参与人数达 3,800 人；开展包括 3.15 权益日-投资者权益保护宣传活动、做“‘理性投资人’”3.15 投资者教育与保护主题系列活动、“远离非法证券活动，传递正能量”打非宣传月、“公平在身边”涉非典型案例征文活动、“2016 年涉嫌非法集资广告资讯信息排查清理活动”、“防范非法证券、非法集资宣传活动”、“普及投资者保护知识”活动、各类高风险业务培训等在内的投资者合法权益保护和教育 243 次，参与人数达 4,000 人。

**2.5 开拓教育扶贫** 公司倡导“一切改变从思想开始”，创办“扶贫先扶智，致富奔小康”的“智·富大讲堂”系列培训，第一期主题为《新经济形势下企业管理突破之道》，获得参训近 300 人的好评。同时，将培训范围拓展至县直经济管理部门干部职工、县乡两级干部。建立了干部双向交流学习制度，通过干部交流，为贫困县培养熟悉资本市场的业务骨干。

**2.6 探索消费扶贫** 2016 年，推荐签约贫困县安化县、新县等地特色农产品，通过中证普惠 APP 进行推广销售。

**2.7 开展公益扶贫** 为汇集公司内外资源，最大限度地发挥公益资金价值，更加专注、专业地参与扶贫和履行社会责任，实现公司与社会的协调发展，公司积极联合子公司筹备成立公益基金会。结合实际，开展“善行无界、大爱有方”系列公益活动之方正证券首批一对一安化公益助学活动，筹款 32.8 万元为 164 名特困安化学子助学，在公司内部营造人人关心、全员参与的公益扶贫氛围。

### 3、上市公司 2016 年精准扶贫工作情况统计表

单位：万元 币种：人民币

| 指 标                 | 数量及开展情况 |
|---------------------|---------|
| 一、总体情况              |         |
| 其中：1. 资金            | 102.80  |
| 2. 物资折款             | 0       |
| 3. 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人） | 164     |
| 二、分项投入              |         |
| 1. 产业发展脱贫           |         |
| 其中：1.1 产业扶贫项目类型     | 农林产业扶贫  |
| 1.2 产业扶贫项目个数（个）     | 1       |
| 1.3 产业扶贫项目投入金额      | 60.00   |
| 2. 转移就业脱贫           |         |
| 3. 易地搬迁脱贫           |         |
| 4. 教育脱贫             |         |
| 其中：4.1 资助贫困学生投入金额   | 32.80   |
| 4.2 资助贫困学生人数（人）     | 164     |
| 5. 健康扶贫             |         |

|                    |       |
|--------------------|-------|
| 6. 生态保护扶贫          |       |
| 7. 兜底保障            |       |
| 8. 社会扶贫            |       |
| 其中：8.1 东西部扶贫协作投入金额 |       |
| 8.2 定点扶贫工作投入金额     |       |
| 8.3 扶贫公益基金         | 10.00 |
| 9. 其他项目            |       |

#### 4、后续精准扶贫计划

2017 年是公司扶贫工作规划正式实施的开局之年。公司将全面贯彻《国务院关于印发“十三五”脱贫攻坚规划的通知》精神，认真落实《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》（证监会公告（2016）19 号），积极响应中国证券业协会发出的开展“一司一县”结对帮扶的倡议，进一步发挥公司及子公司在服务国家脱贫攻坚战略中的作用，坚持真扶贫、扶真贫，主动承担公众公司社会责任，为全面建成小康社会贡献力量。

2017 年公司及子公司将根据实际情况，积极推进，组织实施以下帮扶工作：

**4.1 金融扶贫方面** 通过设立或参与产业基金、协助引入新兴金融业态等支持贫困县精准扶贫，多渠道提供全方位的综合金融服务，支持当地增强自我发展能力。

**4.2 产业扶贫方面** 深化双方协作，帮助当地企业加强融资辅导和培育；利用专项扶持政策，为当地符合条件的企业通过股权市场、货币市场和债券市场等进行融资服务。依托中证机构间报价系统股份有限公司设立的“扶贫板”，为贫困县提供资本对接、产业扶贫、创业支持等，吸引社会资金以私募股权、产品众筹等形式投向当地产业，促进农业产业化，推动县域经济发展。

**4.3 教育扶贫方面** 积极推进“智·富大讲堂”，对贫困地区干部、企业管理人员进行资本市场业务、管理知识等培训，促进企业规范运作。为当地居民提高金融知识水平和风险意识服务，切实保护贫困地区投资者的合法权益。择优录用建档立卡贫困毕业生。

**4.4 消费扶贫** 搭建扶贫对接平台，结合“互联网+”发展战略，拓宽当地特色产品的推介、销售渠道服务，帮助建档立卡贫困户脱贫致富。

**4.5 公益扶贫** 设立公益基金会，结合当地实际开展公益扶贫。公司已建立较完善的保障措施及多项长效机制，保证扶贫工作的顺利实施。

2017 年公司将根据发展战略与扶贫规划，依托当地发展规划和脱贫计划，围绕“精准扶贫、精准脱贫”基本方略，坚持发挥公司专业能力和资源整合优势与提升帮扶县自我发展能力相结合，“造血式”与“输血式”扶贫相结合，突出重点与统筹兼顾相结合的原则，不断使扶贫工作精准化，形成帮扶合力，增强贫困地区自我发展能力，为贫困县打赢脱贫攻坚战提供服务和支持。

#### （二）社会责任工作情况

公司履行社会责任的工作情况请详见公司于本报告披露日同日在上海证券交易所网站披露的《方正证券股份有限公司 2016 年度社会责任报告》。

#### 十八、报告期内公司证券营业部、分公司、专业子公司新设和处置情况

## 1、分公司新设情况

报告期内，公司未新设分公司。

## 2、证券营业部的新设和处置情况

### 2.1 证券营业部新设情况

报告期内，公司未新设证券营业部。

### 2.2 证券营业部搬迁情况

报告期内，公司共完成 4 家证券营业部同城搬迁，具体情况如下：

| 序号 | 原名称                     | 搬迁后名称                  | 搬迁后地址                              |
|----|-------------------------|------------------------|------------------------------------|
| 1  | 方正证券股份有限公司北京通朝大街证券营业部   | 方正证券股份有限公司北京玉带河东街证券营业部 | 北京市通州区玉带河东街 105 号 1-2 层全部          |
| 2  | 方正证券股份有限公司青岛香港中路证券营业部   | 方正证券股份有限公司青岛江西路证券营业部   | 山东省青岛市市南区江西路 106 号 3 户             |
| 3  | 方正证券股份有限公司上海淡水路证券营业部    | 方正证券股份有限公司上海西藏南路证券营业部  | 上海市黄浦区西藏南路 1208 号 10 楼 F 座         |
| 4  | 方正证券股份有限公司株洲茶陵炎帝中路证券营业部 | 方正证券股份有限公司株洲茶陵朝阳街证券营业部 | 茶陵县城关镇朝阳街朝阳新城 2 栋 103-104 门面 1-2 层 |

报告期内，民族证券共完成 4 家证券营业部同城搬迁，具体情况如下：

| 序号 | 原名称                      | 搬迁后名称                     | 搬迁后地址                                      |
|----|--------------------------|---------------------------|--|
| 1  | 中国民族证券有限责任公司上海羽山路证券营业部   | 中国民族证券有限责任公司上海浦明路证券营业部    | 上海市浦东新区浦明路 898 号 7 楼 B 单元                  |
| 2  | 中国民族证券有限责任公司北京丰台东大街证券营业部 | 中国民族证券有限责任公司北京丰台西局欣园证券营业部 | 北京市丰台区西局欣园南区 3 号楼                          |
| 3  | 中国民族证券有限责任公司集安黎明街证券营业部   | 中国民族证券有限责任公司集安建设街证券营业部    | 吉林省通化市集安市建设街 599 号                         |
| 4  | 中国民族证券有限责任公司北京西坝河证券营业部   | 中国民族证券有限责任公司北京望京证券营业部     | 北京市朝阳区望京街 9 号商业楼三层 325-1、325-2、326-1、326-2 |

## 十九、账户规范情况专项说明

公司根据中国证券结算登记有限公司账户管理要求，不断修订、完善各项业务制度，优化业务流程，加强账户管理，强化合规意识，提升账户管理水平。公司在客户身份识别、客户档案管理、账户信息更新等方面持续开展工作，并通过资金账户与证券账户信息定期比对工作，核查客户名称和号码等关键信息的一致性，杜绝新增不合格账户。

根据中国证券结算登记有限公司《关于持续开展规范一码通账户身份信息有关事项的通知》要求，公司对存量账户中存在同一投资者且有多个一码通的进行了一码通账户规范。2016 年 8 月，根据中国证券结算登记有限公司《关于对开户代理业务进行自查的通知》要求，从账户开立环节实名制落实情况、证券账户使用情况、非现场开户业务开展情况、关联关系确认业务开展情况、特殊群体开户及使用情况、日常业务办理情况等多个方面对公司开户代理业务进行了全面自查，并针对自查中发现的问题进行整改。公司结算托管中心负责账户清理规范工作，负责落实监管部门有关精神，制订账户清理工作计划和业务规章制度，协调处理业务开展过程中出现的各种问题，确保账户规范管理工作持续和有效开展。

公司 2016 年度未新增不合格账户，2016 年度规范历史不合格证券账户 8 户，截止 2016 年 12 月 31 日，剩余历史不合格证券账户 769 户；休眠账户 374,657 户；纯资金账户为 45,021 户。全部小额休眠账户、不合格资金及证券账户均已按规定单独管理，相应资金按有关规定在指定商业银行分别集中存放。在办理客户小额休眠账户激活账户手续时，公司严格规范账户激活申请、账户资料补齐等操作，确保账户的真实和权属关系清晰。日常发生的司法冻结账户均按中国证券结算登记有限公司要求进行司法冻结申报处理，将其纳入合格账户类别管理。

## 二十、公司动态风险控制指标监控情况和补足机制建立情况

### （一）报告期公司动态风险控制指标监控情况

根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司全面风险管理规范》等监管规定，公司修订了风险管理相关制度、升级了净资本和流动性风险监控系統。公司通过业务部门的前端控制、风险管理部对风险控制指标的持续动态监控、定期不定期地开展压力测试等多种方式，确保净资本和流动性等各项风险控制指标持续符合监管标准。报告期内，净资本和流动性等各项风险控制指标符合监管标准。风险控制指标超过预警标准的，公司根据监管要求，按时向湖南证监局报送了书面报告。

### （二）净资本补足机制建立情况

公司业务规模快速扩张、现金分红、增加长期股权投资、受到监管处罚，以及市场行情不利变化等内外部因素将影响公司资本的充足。

公司于 2014 年 12 月制定了未来三年的资本规划，并经公司董事会审议通过。公司三年资本规划明确了资本政策、资本充足的标准、资本补充的触发条件以及达到资本补充触发条件时的应对措施、资本补充工具以及资本的管理措施等。在公司资本达到补充触发条件时，公司将采取限制占用资本程度高的业务规模、运用资本补充工具补充资本等措施。

### （三）报告期资本充足情况

2016 年 12 月末，公司净资本达到 218.59 亿元。2016 年，公司通过发行长期次级债、净利润留存等提升公司资本实力，公司发行长期次级债 130 亿元，其中 5 年期 100 亿元（第 3 年末附发行人赎回选择权），3 年期 30 亿元；2016 年公司实现综合收益总额 17.00 亿元，扣除分红 7.41 亿元后，公司净资产增加 9.59 亿元，公司资本和可用稳定资金得到进一步提升。

### （四）内部资本充足评估程序

公司根据宏观环境、监管要求、外部环境、风险偏好、风险管理水平、业务发展等情况的变化，及时对资本规划进行动态调整，确保资本水平与未来业务发展和风险状况相适应。

公司将压力测试作为资本充足评估的重要方法和工具，通过审慎和前瞻性的压力测试，测算和评估不同压力情景下的资本情况。2016 年度，风险管理部对公司年度、月度资产和负债配置计划、增加对子公司的长期股权投资、发行次级债、分类监管评级负向调整、分红等，对风险控制

指标开展专项压力测试，评估资本占用、资本充足、风险控制指标承压等情况，以确保风险控制指标符合监管标准。

## 二十一、可转换公司债券情况

适用  不适用

## 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

报告期内，公司普通股股份总数及股本结构未发生变化。

| 股本结构        |               |         |
|-------------|---------------|---------|
| 股份名称        | 数量(股)         | 比例      |
| 一、有限售条件股份   | 1,942,250,859 | 23.59%  |
| 1、国家持股      |               |         |
| 2、国有法人持股    | 142,689,095   | 1.73%   |
| 3、其他内资持股    | 1,799,561,764 | 21.86%  |
| 其中：境内非国有法人股 | 1,799,561,764 | 21.86%  |
| 境内自然人持股     |               |         |
| 4、外资持股      |               |         |
| 其中：境外法人持股   |               |         |
| 境外自然人持股     |               |         |
| 二、无限售条件流通股  | 6,289,850,536 | 76.41%  |
| 1、人民币普通股    | 6,289,850,536 | 76.41%  |
| 2、境内上市的外资股  |               |         |
| 3、境外上市的外资股  |               |         |
| 4、其他        |               |         |
| 三、股份总数      | 8,232,101,395 | 100.00% |

#### (二) 限售股股份总数变化情况

报告期内，公司限售股股份总数未发生变化。

| 股东名称          | 年初限售股数(股)     | 本年解除限售股数 | 年末限售股数(股)     | 限售原因     | 解除限售日期     |
|---------------|---------------|----------|---------------|----------|------------|
| 兵工财务有限责任公司    | 36,733,250    | -        | 36,733,250    | 发行股份购买资产 | 2017-08-08 |
| 北京政泉控股有限公司    | 1,799,561,764 | -        | 1,799,561,764 | 发行股份购买资产 | 2017-08-08 |
| 乐山市国有资产经营有限公司 | 105,955,845   | -        | 105,955,845   | 发行股份购买资产 | 2017-08-08 |
| 合计            | 1,942,250,859 | -        | 1,942,250,859 | -        | -          |

### 二、证券发行与上市情况

#### (一) 截至报告期内证券发行情况

报告期内，公司无证券发行情况。

#### (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，公司股份总数无变化，为 8,232,101,395 股。报告期内有限售条件流通股无解除限售、上市流通情况。公司股份结构变动对公司资产负债结构无重大影响。

#### (三) 公司目前无内部职工股

### 三、股东和实际控制人情况

#### (一) 报告期末股东总数

|                  |         |
|------------------|---------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户) | 310,100 |
|------------------|---------|

|                         |         |
|-------------------------|---------|
| 年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户) | 284,103 |
|-------------------------|---------|

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

| 前十名股东持股情况                                       |   |               |               |                        |          |               |             |
|---|---|---------------|---------------|------------------------|----------|---------------|-------------|
| 股东名称<br>(全称)                                    | 报告期内增减<br>(股)   | 期末持股数量<br>(股) | 比例(%)         | 持有有限售条<br>件股份数量<br>(股) | 质押或冻结情况  |               | 股东<br>性质    |
|   |   |               |               |                        | 股份<br>状态 | 数量(股)         |             |
| 北大方正集团有<br>限公司                                  | 0   | 2,284,609,852 | 27.75         | 0                      | 质押       | 1,701,304,926 | 国有法人        |
| 北京政泉控股有<br>限公司                                  | 0   | 1,799,591,164 | 21.86         | 1,799,561,764          | 冻结       | 1,799,591,164 | 境内非国<br>有法人 |
| 哈尔滨哈投投资<br>股份有限公司                               | 0   | 197,556,999   | 2.4           | 0                      | 无        | 0             | 境内非国<br>有法人 |
| 中国证券金融股<br>份有限公司                                | -15,830,454   | 186,264,862   | 2.26          | 0                      | 无        | 0             | 国有法人        |
| 中央汇金资产管<br>理有限责任公司                              | 0   | 138,731,200   | 1.69          | 0                      | 无        | 0             | 国有法人        |
| 方正产业控股有<br>限公司                                  | 0   | 127,048,700   | 1.54          | 0                      | 质押       | 127,048,700   | 国有法人        |
| 万华天智投资发<br>展有限公司                                | 0   | 121,900,000   | 1.48          | 0                      | 质押       | 121,900,000   | 境内非国<br>有法人 |
| 乐山市国有资产<br>经营有限公司                               | 0   | 105,955,845   | 1.29          | 105,955,845            | 质押       | 40,000,000    | 国有法人        |
| 香港中央结算有<br>限公司                                  | 90,626,066  | 90,626,066    | 1.10          |                        | 无        |               | 未知          |
| 中国银行股份有<br>限公司-招商中<br>证全指证券公司<br>指数分级证券投<br>资基金 | 47,312,890  | 60,226,933    | 0.73          |                        | 无        |               | 未知          |
| 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<br>数量(股)  | 股份种类及数量       |               |                        |          |               |             |
|   |   | 种类            | 数量(股)         |                        |          |               |             |
| 北大方正集团有限公司                                      | 2,284,609,852   | 人民币普通股        | 2,284,609,852 |                        |          |               |             |
| 哈尔滨哈投投资股份有限公司                                   | 197,556,999   | 人民币普通股        | 197,556,999   |                        |          |               |             |
| 中国证券金融股份有限公司                                    | 186,264,862   | 人民币普通股        | 186,264,862   |                        |          |               |             |
| 中央汇金资产管理有限责任公司                                  | 138,731,200   | 人民币普通股        | 138,731,200   |                        |          |               |             |
| 方正产业控股有限公司                                      | 127,048,700   | 人民币普通股        | 127,048,700   |                        |          |               |             |
| 万华天智投资发展有限公司                                    | 121,900,000   | 人民币普通股        | 121,900,000   |                        |          |               |             |
| 香港中央结算有限公司                                      | 90,626,066  | 人民币普通股        | 90,626,066    |                        |          |               |             |
| 中国银行股份有限公司-招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金                 | 60,226,933  | 人民币普通股        | 60,226,933    |                        |          |               |             |
| 东方集团股份有限公司                                      | 54,160,115  | 人民币普通股        | 54,160,115    |                        |          |               |             |
| 博时基金-农业银行-博时中证金融资产管理计划                          | 53,580,300  | 人民币普通股        | 53,580,300    |                        |          |               |             |
| 嘉实基金-农业银行-嘉实中证金融资产管理计划                          | 53,580,300  | 人民币普通股        | 53,580,300    |                        |          |               |             |
| 中欧基金-农业银行-中欧中证金融资产管理计划                          | 53,580,300  | 人民币普通股        | 53,580,300    |                        |          |               |             |
| 银华基金-农业银行-银华中证金融资产管理计划                          | 53,580,300  | 人民币普通股        | 53,580,300    |                        |          |               |             |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明                                | 公司向上述股东书面询证并取得书面回复的情况如下：<br>1、方正集团与方正产业控股有限公司确认为关联关系：方正产业控股有限公司为方正集团控股子公司，除此之外，与上述其他股东不存在关联关系或一致行动关系；<br>2、政泉控股、哈尔滨哈投投资股份有限公司、万华天智投资发展有限公司、乐山市国有资产经营有限公司、东方集团股份有限公司确认与上述其他股东不存在关联关系或一致行动关系。 |               |               |                        |          |               |             |
| 表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明                             | 无优先股  |               |               |                        |          |               |             |

(三) 前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位:股

| 有限售条件股东名称        | 持有的有限售条件股份数量(股)                                    | 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 |              |
| 北京政泉控股有限公司       | 1,799,561,764                                      | 2017-08-08     | -           | 自上市之日起锁定36个月 |
| 乐山市国有资产经营有限公司    | 105,955,845  | 2017-08-08     | -           | 自上市之日起锁定36个月 |
| 兵工财务有限责任公司       | 36,733,250   | 2017-08-08     | -           | 自上市之日起锁定36个月 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 公司向上述股东书面询证并取得书面回复的情况如下:上述股东均确认相互之间不存在关联关系或一致行动关系。 |                |             |              |

四、控股股东及实际控制人情况

方正集团为本公司控股股东。北大资产经营有限公司持有方正集团70%股权,为方正集团的控股股东。北大资产经营有限公司是北京大学根据《国务院办公厅关于北京大学清华大学规范校办企业管理体制试点问题的通知》(国办函[2001]58号)于2002年成立的管理和经营北京大学校办企业的重要载体和平台,北京大学持有其100%股权,北京大学为公司实际控制人。

(一) 控股股东情况

名称:北大方正集团有限公司

法定代表人:肖建国

成立时间:1992年12月12日

统一社会信用代码:91110108101974963M

注册资本:110,252.86万元

经营范围:制造方正电子出版系统、方正-SUPPER 汉卡、计算机软硬件及相关设备、通讯设备、仪器仪表、办公自动化设备;技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务、技术推广;投资管理;财务咨询(不得开展审计、验资、查账、评估、会计咨询、代理记账等需经专项审批的业务,不得出具相应的审计报告、验资报告、查账报告、评估报告等文字材料);销售电子产品、自行开发的产品、计算机、软件及辅助设备、仪器仪表、机械设备、非金属矿石、金属矿石、黄金制品、金属材料、建筑材料、化工产品(不含危险化学品及一类易制毒化学品);货物进出口、代理进出口、技术进出口;装卸服务;仓储服务;包装服务;房地产开发;物业管理。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动;不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。)

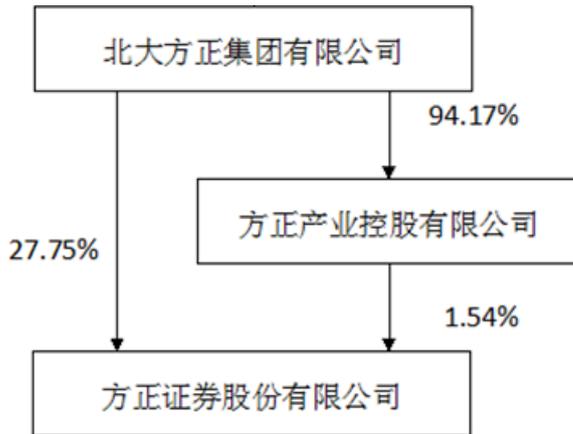
报告期内,控股股东直接或间接控股和参股的其他境内外上市公司情况如下表所示:

| 上市公司名称       | 持股比例   | 上市地点    |
|--------------|--------|---------|
| 中国高科集团股份有限公司 | 20.03% | 上海证券交易所 |
| 方正科技集团股份有限公司 | 11.65% | 上海证券交易所 |

|              |        |         |
|--------------|--------|---------|
| 北大医药股份有限公司   | 34.57% | 深圳证券交易所 |
| 方正控股有限公司     | 30.60% | 香港联合交易所 |
| 北大资源（控股）有限公司 | 46.66% | 香港联合交易所 |
| 重庆银行股份有限公司   | 3.02%  | 香港联合交易所 |

**公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图**

经公司向控股股东方正集团书面询证，方正集团确认的公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图如下：

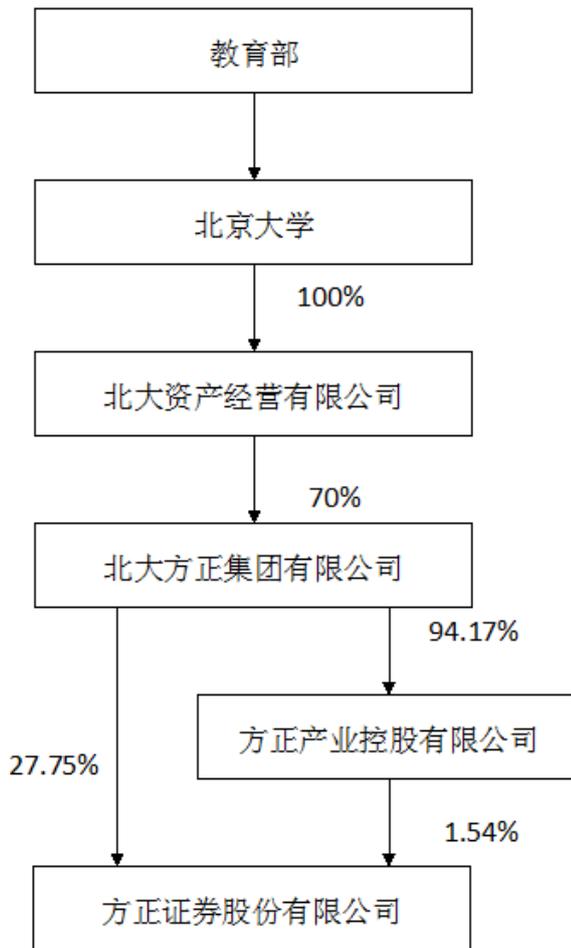


**（二）实际控制人情况**

北京大学创办于 1898 年，初名京师大学堂，是中国第一所国立综合性大学，主要从事教学和科研，现任校党委书记郝平教授、校长林建华教授。报告期内，除方正集团所持境内外上市公司股权外，北京大学通过北大资产经营有限公司直接或间接控股和参股的其他境内外上市公司情况：北大资产经营有限公司持有北京北大未名生物工程集团有限公司 40%的股权，北京北大未名生物工程集团有限公司持有山东未名生物医药股份有限公司（证券代码：002581）26.38%的股份。

**公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图**

经公司向控股股东方正集团书面询证，方正集团确认的公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图如下：



### 五、其他持股在百分之十以上的法人股东

截至本报告期末，政泉控股为公司第二大股东，持有公司 1,799,591,164 股，占公司总股本 21.86%，基本情况如下：

名称：北京政泉控股有限公司

法定代表人：贾鑫

成立时间：2002 年 01 月 08 日

营业执照注册号：110000003499108

注册资本：340,000 万元

注册地址：北京市朝阳区大屯里 315 号 1-4 层、316 号 1-4 层、317 号、318 号 1-4 层

经营范围：物业管理；电影放映；项目投资；房地产开发；销售自行开发后的商品房；机动车公共停车场服务；投资管理；经济信息咨询；组织文化交流活动（演出除外）；会议服务；承办展览展示活动；电脑动画设计；技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务；货物进出口；零售服装鞋帽、珠宝首饰、家具、建筑材料、花、草及观赏植物、针纺织品、日用品、新鲜蔬菜、新鲜水果、未经加工的干果、坚果、黄金制品、工艺美术品、玩具、摄影器材、家用电器、通讯

设备、文化体育用品、化妆品、电子产品、礼品、钟表、眼镜、皮革制品、五金交电、机械设备、化工产品（不含危险化学品及一类易制毒化学品）；家居装饰；维修家用电器；验光配镜；日用品修理；摄影扩印服务；委托加工首饰；包装服务；服装加工；设计、制作、代理、发布广告；出租办公用房；出租商业用房；企业管理；汽车装饰；家庭劳务服务。

## 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

| 姓名  | 职务        | 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 | 报告期内从公司领取的应付报酬税后总额(人民币万元) | 报告期内应付报酬总额应缴个人所得税(人民币万元) | 是否在公司关联方获取报酬 |
|-----|-----------|----|----|-------------|------------|-------|-------|------------|--------|---------------------------|--------------------------|--------------|
| 高利  | 董事长       | 男  | 56 | 2016.12.02  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 340.70                    | 227.40                   | 否            |
|     | 执行委员会主任   |    |    | 2016.12.02  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
|     | 副总裁       |    |    | 2014.08.08  | 2016.11.24 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 何亚刚 | 董事        | 男  | 53 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 394.04                    | 276.93                   | 否            |
|     | 总裁        |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
|     | 执行委员会副主任  |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 汪辉文 | 董事        | 男  | 55 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 15.00                     | 5.00                     | 是            |
| 车莉丽 | 董事        | 女  | 37 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 13.30                     | 4.20                     | 是            |
| 徐昂杨 | 董事        | 男  | 39 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 3.15                      | 1.65                     | 否            |
| 廖航  | 董事        | 女  | 38 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 3.15                      | 1.65                     | 是            |
| 叶林  | 独立董事      | 男  | 54 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 15.00                     | 5.00                     | 否            |
| 李明高 | 独立董事      | 男  | 47 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 3.15                      | 1.65                     | 否            |
| 胡廷华 | 独立董事      | 男  | 45 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 3.15                      | 1.65                     | 否            |
| 雍苹  | 监事会主席     | 女  | 52 | 2016.12.16  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 162.07                    | 86.95                    | 否            |
| 郑华  | 监事        | 男  | 59 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 144.75                    | 75.81                    | 否            |
| 马楠  | 监事        | 女  | 32 | 2016.11.24  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 0                         | 0                        | 否            |
| 卫剑波 | 副总裁       | 男  | 44 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 269.52                    | 169.16                   | 否            |
|     | 财务负责人     |    |    | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
|     | 执行委员会委员   |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 孙斌  | 合规总监      | 男  | 49 | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 286.17                    | 182.78                   | 否            |
|     | 执行委员会委员   |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 吴姚东 | 副总裁       | 男  | 48 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 287.43                    | 188.52                   | 否            |
|     | 执行委员会委员   |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 吴珂  | 副总裁       | 男  | 39 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 279.00                    | 176.92                   | 否            |
|     | 执行委员会委员   |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 徐子兵 | 副总裁       | 男  | 52 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 435.52                    | 325.49                   | 否            |
|     | 执行委员会委员   |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 施光耀 | 副总裁       | 男  | 56 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 274.89                    | 173.55                   | 否            |
| 姜志军 | 副总裁       | 男  | 48 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 246.72                    | 150.81                   | 否            |
| 熊郁柳 | 副总裁       | 女  | 35 | 2017.01.031 | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 228.30                    | 135.43                   | 否            |
|     | 董事会秘书     |    |    | 2016.12.21  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |
| 陈飞  | 首席风险官     | 男  | 54 | 2017.01.03  | 2019.11.23 | -     | -     | -          | -      | 568.93                    | 435.04                   | 否            |
| 何其聪 | 离任董事长     | 男  | 45 | 2015.03.12  | 2016.11.24 | -     | -     | -          | -      | 444.92                    | 312.67                   | 否            |
|     | 离任执行委员会主任 |    |    | 2015.03.12  | 2016.11.24 | -     | -     | -          | -      |                           |                          |              |

|     |         |   |    |            |            |   |   |   |   |          |          |   |
|-----|---------|---|----|------------|------------|---|---|---|---|----------|----------|---|
| 韦俊民 | 离任董事    | 男 | 54 | 2015.02.27 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 13.66    | 4.37     | 是 |
| 黄卫平 | 离任独立董事  | 男 | 66 | 2015.02.27 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 13.66    | 4.37     | 否 |
| 赵志军 | 离任独立董事  | 男 | 46 | 2015.02.27 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 13.66    | 4.37     | 否 |
| 陈晓龙 | 离任董事    | 男 | 54 | 2015.02.27 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 13.66    | 4.37     | 否 |
| 赵大健 | 离任董事    | 男 | 64 | 2015.02.27 | 2016.02.19 | - | - | - | - |          |          | 否 |
| 陆琦  | 离任监事会主席 | 女 | 51 | 2015.02.27 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 148.68   | 70.14    | 否 |
| 杨克森 | 离任监事    | 女 | 50 | 2015.02.27 | 2016.02.19 | - | - | - | - |          |          | 否 |
| 徐建伟 | 离任监事    | 男 | 59 | 2016.02.19 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 12.18    | 3.35     | 是 |
| 赵亚男 | 离任高管    | 女 | 34 | 2015.08.17 | 2016.04.28 | - | - | - | - | 155.72   | 110.96   | 否 |
| 陈锐  | 离任高管    | 女 | 46 | 2013.10.30 | 2016.11.07 | - | - | - | - | 208.93   | 125.07   | 否 |
| 彭子瑄 | 离任高管    | 女 | 47 | 2015.08.19 | 2016.11.24 | - | - | - | - | 319.57   | 230.62   | 否 |
| 潘明伟 | 离任高管    | 男 | 50 | 2013.10.30 | 2017.01.03 | - | - | - | - | 221.37   | 129.76   | 否 |
| 合计  | /       | / | /  | /          | /          |   |   |   |   | 5,539.95 | 3,625.64 | / |

注 1：公司董事会于 2017 年 1 月 10 日收到董事车莉丽女士的书面辞职申请，车莉丽女士的辞职不会导致公司董事会成员人数低于法定人数，即时生效。

注 2：高级管理人员徐子兵、陈飞和离任高级管理人员彭子瑄在本公司全资子公司民族证券领取薪酬。

注 3：公司暂未实施股权激励，上述人员未持有公司的股票期权及被授予限制性股票；

注 4：公司董事、监事、高级管理人员 2016 年度绩效奖金仍在确认过程中，将提交董事会审核后确定。2016 年董事、监事、高级管理人员的固定工资已全额发放，绩效奖金的不超过 60%部分在董事会审核后发放，不低于 40%部分将采取延期支付方式，并遵循等分原则 3 年内支付完毕。

注 5：应付监事马楠监事津贴 19,697.00 元（含税）尚未支付。

## （二）现任董事、监事、高级管理人员最近五年工作经历

### 1、现任董事工作经历

高利先生，1961 年 11 月出生，硕士。2009 年至 2014 年 8 月任华创证券有限责任公司副总裁；2014 年 8 月至 2016 年 12 月任公司副总裁、研究所负责人；2016 年 1 月至 12 月兼任公司 QFII 业务部负责人；2015 年 8 月至今兼任民族证券副总裁；2016 年 4 月至 12 月任公司执行委员会委员；2017 年 3 月任瑞信方正董事长；现任公司董事长、执行委员会主任。

何亚刚先生，1964 年 5 月出生，硕士。2010 年 9 月至 2015 年 7 月任公司副总裁；2015 年 7 月至 2016 年 11 月任公司执行委员会委员、总裁；2015 年 2 月至 2016 年 11 月任公司董事；现任公司董事、执行委员会副主任、总裁，兼任民族证券董事长、瑞信方正监事会主席、方正中期董事、方正富邦监事。

汪辉文先生，1961 年 12 月出生，硕士。2005 年 6 月至今任万华天智投资发展有限公司副总经理；2006 年 8 月至今任中国北方稀土（集团）高科技股份有限公司副董事长；2006 年 12 月至今任北京嘉信保险代理公司董事长；2007 年 4 月至今任北京嘉信保险经纪公司董事长；2007 年 11 月至今任四川嘉信保险代理公司董事；2008 年 6 月至 2010 年 9 月任方正证券有限责任公司董事。2010 年 9 月至 2016 年 11 月任公司第一届董事会董事、第二届董事会董事。

车莉丽女士，1980 年 5 月出生，法律专业学士学位。2005 年 3 月至 2011 年 8 月任北京市释胜律师事务所律师；2011 年至今任北京政泉控股有限公司法务总监。

徐昂杨先生，1978年10月出生，本科。2005年10月至2011年8月在北京市中凯律师事务所就职；2011年9月至2016年8月历任政泉控股法务部副经理、经理，金融发展部总监；2016年8月至今任北京盘古氏投资有限公司副总经理。

廖航女士，1979年4月出生，硕士。2007年6月至2010年12月历任方正集团综合事业群资产管理部法务助理、法务高级专员、法务经理；2010年12月至2012年11月历任北大方正物产集团有限公司资产管理部法务经理、风险管理部法务经理、风险管理部法务总监；2012年12月至今历任方正集团法务部高级法务经理、总监、总经理。

叶林先生，1963年11月出生，法学博士。曾任2005年公司法修改专家小组成员、深圳华侨城控股股份有限公司独立董事、广东冠豪高新技术股份有限公司独立董事、汇丰晋信基金管理有限公司独立董事、香港动感集团公司独立董事；现任中国人民大学法学院民商法教研室主任、中国法学会商法学研究会副会长，北京市法学会民商法研究会副会长，北京市消费者权益保护法学会常务副会长、中国律师协会公司法专业委员会顾问、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、淄博仲裁委员会仲裁员；兼任大成基金管理有限公司、金一文化股份有限公司、贵人鸟股份有限公司独立董事。

李明高先生，1970年11月出生，硕士。2008年1月至今任立信会计师事务所权益合伙人，2014年7月至今任北京盈建科软件股份有限公司董事；2015年6月至今任北京君正集成电路股份有限公司独立董事；2015年10月至今任国机汽车股份有限公司独立董事；2016年1月至今任北京捷成世纪科技股份有限公司独立董事；现任中国商业会计学会副会长、北京注册会计师协会理事。

胡廷华先生，1972年9月出生，硕士、EMBA。2006年1月至2013年8月任中信资本中国股权投资基金执行董事；2013年9月至2015年3月任中银投资浙商产业基金董事总经理；2015年4月至今任丰甲资产管理（上海）有限公司执行董事、总经理。

## 2、现任监事工作经历

雍莘女士，1965年8月出生，硕士。1997年7月至2015年12月历任方正证券财务管理部总经理、稽核审计部总经理、监事会办公室总经理（兼任）。2016年1月至今任公司稽核审计部执行董事（ED）。

郑华先生，1957年9月出生，大专。曾任方正证券有限责任公司工会副主席；历任公司工会副主席、第一届监事会职工代表监事、第二届监事会职工代表监事。现任公司工会主席、党委办公室主任。

马楠女士，1985年6月出生，硕士。2009年6月至今，历任盘古氏投资有限公司法务部副经理、经理及法务部总监。

## 3、现任高级管理人员工作经历

卫剑波先生，1973年3月出生，硕士。2003年4月至2012年3月就职于中国证监会，历任国际部主任科员、基金监管部监管四处副处长、监管一处和监管五处调研员；2012年3月至2012

年 6 月任方正资本控股股份有限公司副总裁；2012 年 7 月至今任公司党委副书记；2013 年 5 月至今任公司执行委员会委员、副总裁；2015 年 8 月至今任民族证券副总裁；2016 年 2 月至今任公司财务负责人；2016 年 2 月至今任民族证券财务总监；2016 年 4 月至今任民族证券董事；2016 年 5 月至今任方正投资董事；2016 年 6 月至今任方正中期董事。

孙斌先生，1968 年 4 月出生，硕士。2010 年 9 月至今任公司合规总监；2011 年 11 月至今任方正和生董事；2013 年 2 月至今任公司执行委员会委员；2014 年 8 月至 2016 年 1 月任公司首席风险官；2014 年 4 月至今任方正投资监事长；2015 年 1 月至今任瑞信方正董事；2015 年 8 月至 2016 年 2 月任民族证券首席风险官；2015 年 8 月至今任民族证券合规总监。

吴姚东先生，1969 年 1 月出生，博士。2008 年 5 月至 2013 年 4 月任招商证券股份有限公司总裁助理、总裁办公室董事总经理；2013 年 4 月至 2015 年 5 月任博时基金管理有限公司总裁；2015 年 5 月至 7 月任招商证券股份有限公司总裁助理；2015 年 7 月至今任公司副总裁；2015 年 10 月至今任公司执行委员会委员；2016 年 8 月至今任方正香港董事。

吴珂先生，1978 年 11 月出生，硕士。2010 年 3 月至 2013 年 5 月任公司助理总裁；2010 年 8 月至 2015 年 3 月任公司人力资源部总经理；2013 年 5 月至今任公司副总裁；2015 年 8 月至今任民族证券副总裁；2016 年 4 月至今任公司执行委员会委员。

徐子兵先生，1965 年出生，硕士。曾任深圳市龙岗区投资管理公司项目经理，联合证券有限公司项目经理，新华信托股份有限公司副总经理，长春证券有限责任公司副总经理，新世纪基金管理有限公司常务副总经理，新产业创业投资有限公司总经理，民族证券副总裁；现任民族证券董事、总裁、公司执行委员会委员。

施光耀先生，1961 年 5 月出生，研究生。2008 年 5 月至 2013 年 12 月任方正中期董事；2009 年 3 月至今任公司副总裁；2012 年 11 月至 2016 年 12 月任公司执行委员会委员。2015 年 8 月至今，兼任民族证券董事；2017 年 1 月至今任民族证券副总裁。

姜志军先生，1969 年 2 月出生，硕士。2008 年 7 月至 2015 年 12 月历任方正证券有限责任公司、方正证券机构管理部、法律合规部、运营管理部、网点运营部、经纪业务管理部总经理；2013 年 7 月至今任公司北京分公司总经理；2015 年 3 月至 2016 年 7 月任公司助理总裁；2015 年 11 月至今任方正中期董事长；2016 年 7 月至今任民族证券副总裁；2016 年 7 月至今任公司副总裁。

熊郁柳女士，1982 年 4 月出生，硕士。2010 年 3 月至 2012 年 6 月历任北大医药股份有限公司董事会秘书办公室主任、助理总裁、董事会秘书；2012 年 6 月至 2015 年 3 月任公司董事会办公室主任总经理；2013 年 1 月至 2014 年 11 月任公司助理总裁；2014 年 11 月至今任公司董事会秘书；2015 年 8 月至今任民族证券董事会秘书；2015 年 8 月至今任公司副总裁。

陈飞先生，1963 年 2 月出生，本科。2002 年 5 月至 2015 年 8 月，历任民族证券沈阳证券营业部负责人、沈阳南街证券营业部总经理、沈阳中心营业部总经理、风险监控部总经理、固定收益部总经理、证券投资部总经理、总裁助理；2015 年 8 月至 2016 年 2 月任民族证券助理总裁；2016 年 2 月至今任公司首席风险官；2016 年 2 月至今任民族证券首席风险官。

(二) 董事、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

| 任职人员姓名 | 股东单位名称       | 在股东单位担任的职务    | 任期起始日期      | 任期终止日期     |
|--------|--------------|---------------|-------------|------------|
| 韦俊民    | 北大方正集团有限公司   | 董事            | 2015 年 1 月  | 2016 年 1 月 |
| 廖航     | 北大方正集团有限公司   | 法务部总经理        | 2012 年 12 月 |            |
| 汪辉文    | 万华天智投资发展有限公司 | 副总经理          | 2005 年 6 月  |            |
| 车莉丽    | 北京政泉控股有限公司   | 法务总监          | 2011 年 8 月  |            |
| 徐建伟    | 哈投投资股份有限公司   | 董事、董事会秘书、副总经理 | 1996 年 1 月  |            |

(二) 在其他单位任职情况

| 任职人员姓名 | 其他单位名称              | 在其他单位担任的职务  | 任期起始日期      | 任期终止日期 |
|--------|---------------------|-------------|-------------|--------|
| 高利     | 民族证券                | 副总裁         | 2015 年 8 月  |        |
|        | 瑞信方正                | 董事长         | 2017 年 3 月  |        |
| 何亚刚    | 方正中期                | 董事          | 2013 年 12 月 |        |
|        | 民族证券                | 董事长         | 2015 年 8 月  |        |
|        | 方正富邦                | 监事          | 2015 年 4 月  |        |
| 汪辉文    | 瑞信方正                | 监事会主席       | 2015 年 4 月  |        |
|        | 中国北方稀土（集团）高科技股份有限公司 | 副董事长        | 2006 年 8 月  |        |
|        | 北京嘉信保险代理公司          | 董事长         | 2006 年 12 月 |        |
|        | 北京嘉信保险经纪公司          | 董事长         | 2007 年 4 月  |        |
| 徐昂杨    | 四川嘉信保险代理公司          | 董事          | 2007 年 11 月 |        |
|        | 盘古氏投资有限公司           | 副总经理        | 2016 年 8 月  |        |
| 叶林     | 中国人民大学法学院           | 教授          | 2001 年 7 月  |        |
|        | 贵人鸟股份有限公司           | 独立董事        | 2011 年 10 月 |        |
|        | 金一文化股份有限公司          | 独立董事        | 2015 年 4 月  |        |
|        | 大成基金管理有限公司          | 独立董事        | 2015 年 1 月  |        |
| 李明高    | 立信会计师事务所            | 权益合伙人       | 2008 年 1 月  |        |
|        | 北京盈建科软件股份有限         | 独立董事        | 2014 年 7 月  |        |
|        | 北京君正集成电路股份有限公司      | 独立董事        | 2015 年 6 月  |        |
|        | 国机汽车股份有限公司          | 独立董事        | 2015 年 10 月 |        |
| 胡廷华    | 北京捷成世纪科技股份有限公司      | 独立董事        | 2016 年 1 月  |        |
| 马楠     | 丰甲资产管理（上海）有限公司      | 执行董事、总经理    | 2015 年 4 月  |        |
| 卫剑波    | 盘古氏投资有限公司           | 法务部总监       | 2009 年 6 月  |        |
|        | 民族证券                | 董事、副总裁、财务总监 | 2015 年 8 月  |        |
|        | 方正中期                | 董事          | 2016 年 6 月  |        |
| 孙斌     | 方正投资                | 董事          | 2016 年 5 月  |        |
|        | 民族证券                | 合规总监        | 2015 年 8 月  |        |
|        | 方正和生                | 董事          | 2011 年 11 月 |        |
|        | 方正投资                | 监事长         | 2014 年 4 月  |        |
| 吴珂     | 瑞信方正                | 董事          | 2015 年 1 月  |        |
|        | 民族证券                | 副总裁         | 2015 年 8 月  |        |
|        | 方正投资                | 董事          | 2016 年 5 月  |        |
| 徐子兵    | 方正中期                | 董事          | 2017 年 1 月  |        |
|        | 民族证券                | 董事、总裁       | 2015 年 8 月  |        |
| 施光耀    | 方正投资                | 董事          | 2016 年 5 月  |        |
|        | 民族证券                | 董事、副总裁      | 2015 年 8 月  |        |
| 姜志军    | 民族证券                | 副总裁         | 2016 年 7 月  |        |
|        | 方正中期                | 董事长         | 2015 年 11 月 |        |

|     |      |       |             |            |
|-----|------|-------|-------------|------------|
| 熊郁柳 | 民族证券 | 董事会秘书 | 2015 年 8 月  |            |
| 陈飞  | 民族证券 | 首席风险官 | 2016 年 2 月  |            |
| 吴姚东 | 方正香港 | 董事    | 2016 年 8 月  |            |
| 何其聪 | 方正中期 | 董事    | 2013 年 12 月 |            |
|     | 方正和生 | 董事长   | 2013 年 6 月  |            |
|     | 方正富邦 | 董事长   | 2015 年 4 月  |            |
|     | 瑞信方正 | 董事长   | 2015 年 4 月  | 2017 年 3 月 |
|     | 方正投资 | 董事长   | 2015 年 4 月  |            |
|     | 方正香港 | 董事    | 2015 年 5 月  |            |

### 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         | 根据《方正证券股份有限公司章程》，董事、监事薪酬由股东大会决定，高级管理人员薪酬由董事会决定               |
| 董事、监事、高级管理人员报酬确定依据          | 董事、监事薪酬标准参照同行业上市公司薪酬水平及公司实际情况确定，高级管理人员薪酬按照公司薪酬制度确定，与岗位和绩效挂钩。 |
| 董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况       | 详见本节“董事、监事、高级管理人员基本情况”。                                      |
| 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 | 9,165.59 万元  |

### 四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

#### (一) 报告期内董事变更情况

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形 | 变动原因   |
|-----|-------|------|--------|
| 何其聪 | 董事长   | 离任   | 换届     |
| 韦俊民 | 董事    | 离任   | 换届     |
| 黄卫平 | 独立董事  | 离任   | 换届     |
| 赵志军 | 独立董事  | 离任   | 换届     |
| 陈晓龙 | 董事    | 离任   | 换届     |
| 赵大建 | 董事    | 离任   | 股东大会解除 |
| 高利  | 董事长   | 选举   | 董事会选举  |
| 廖航  | 董事    | 选举   | 股东大会选举 |
| 车莉丽 | 董事    | 选举   | 股东大会选举 |
| 徐昂杨 | 董事    | 选举   | 股东大会选举 |
| 廖航  | 董事    | 选举   | 股东大会选举 |
| 李明高 | 独立董事  | 选举   | 股东大会选举 |
| 胡廷华 | 独立董事  | 选举   | 股东大会选举 |

#### (二) 报告期内监事变更情况

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形 | 变动原因   |
|-----|-------|------|--------|
| 杨克森 | 监事    | 离任   | 股东大会解除 |
| 徐建伟 | 监事    | 离任   | 换届     |
| 陆琦  | 监事会主席 | 离任   | 换届     |
| 雍莘  | 监事会主席 | 选举   | 监事会选举  |
| 马楠  | 监事    | 选举   | 股东大会选举 |

(三) 报告期内高级管理人员变更情况

| 姓名  | 担任职务    | 变动情形 | 变动原因  |
|-----|---------|------|-------|
| 高利  | 执行委员会主任 | 聘任   | 董事会聘任 |
| 姜志军 | 副总裁     | 聘任   | 董事会聘任 |
| 陈飞  | 首席风险官   | 聘任   | 董事会聘任 |
| 何其聪 | 执行委员会主任 | 离任   | 换届    |
| 赵亚男 | 副总裁     | 离任   | 工作原因  |
|     | 财务负责人   | 离任   | 工作原因  |
| 陈锐  | 副总裁     | 离任   | 工作原因  |
| 孙斌  | 首席风险官   | 离任   | 工作原因  |

五、董事会下设各类专门委员会的人员构成情况

报告期内董事会专业委员会构成情况如下：

- (一) 战略发展委员会。主任委员：高利；委员：何亚刚、廖航、徐昂杨、叶林
- (二) 风险控制委员会。主任委员：廖航；委员：何亚刚、徐昂杨
- (三) 审计委员会。主任委员：李明高；委员：叶林、车莉丽
- (四) 提名委员会。主任委员：叶林；委员：高利、胡廷华
- (五) 薪酬与考核委员会。主任委员：胡廷华；委员：汪辉文、李明高

六、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用 不适用

七、母公司和主要子公司的员工情况

(一) 员工情况

截至 2016 年末，公司共有员工 7,777 人，其中，母公司员工 5,450 人，需公司承担费用的退休人员共有 46 人。

| 项目                     | 数量(人) |
|------------------------|-------|
| 母公司在职工的数量              | 5450  |
| 主要子公司在职工的数量            | 2327  |
| 在职工的数量合计               | 7777  |
| 母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数 | 46    |
| 专业构成                   |       |
| 专业构成类别                 | 数量(人) |
| 经纪业务人员                 | 5673  |
| 机构与销售交易业务人员            | 193   |
| 自营业务人员                 | 56    |
| 投资银行业务人员               | 344   |
| 资产管理业务人员               | 149   |
| 研究与 QFII 业务人员          | 182   |
| 期货业务人员                 | 470   |
| 基金业务人员                 | 44    |
| 直投业务人员                 | 23    |

|               |              |
|---------------|--------------|
| 财务人员          | 97           |
| 行政人员          | 106          |
| 信息技术人员        | 128          |
| 法律合规人员        | 46           |
| 稽核审计人员        | 22           |
| 风险管理人員        | 29           |
| 人力资源人员        | 47           |
| 其他            | 168          |
| 合计            | 7777         |
| <b>年龄构成</b>   |              |
| <b>年龄构成类别</b> | <b>数量(人)</b> |
| 30岁(含)以下      | 3435         |
| 31-40岁        | 2724         |
| 41-50岁        | 1440         |
| 51岁(含)以上      | 178          |
| 合计            | 7777         |
| <b>教育程度</b>   |              |
| <b>教育程度类别</b> | <b>数量(人)</b> |
| 研究生及以上学历人员    | 1239         |
| 大学本科学历人员      | 5306         |
| 大专学历人员        | 1122         |
| 大专以下学历人员      | 110          |
| 合计            | 7777         |

## (二) 薪酬政策

公司员工薪酬由固定年薪、绩效年薪、特殊奖励和福利构成。固定年薪根据岗位价值、个人能力及市场水平综合确定。绩效年薪与公司当年经营业绩挂钩，并根据部门及个人绩效进行分配。

为鼓励创新协作精神，增强公司凝聚力和创造力，设立了“犇牛奖”等特殊奖励，奖励为公司发展作出突出贡献或出色完成任务的团队和个人。

公司根据国家相关法律、法规的规定，为员工缴纳各类社会保险及住房公积金。在基本医疗保险的基础上，公司为员工建立了商业保险。

## (三) 培训计划

基于公司整体战略及 2017 年经营管理重点，2017 年的培训工作将以强化人才培养、打造文化体系为主要工作方向。

围绕支持业务发展，组织大机构业务海量培训，强化机构业务及研究人员“传帮带”的运作机制，加强网点标准化与综合化培训。持续推进“专项业务资质认证项目”，强化展业人员的专业知识和技能，强化专项业务的合规管理，推动业务发展。联合相关部门开展“轮岗学习项目”，加强板块间、部门间、总部与分支机构间的业务互动，深入了解相关部门的业务流程及规范，打造更顺畅的协同机制。积极开展“国际交流学习项目”、“业务公开课”、“业务半月谈”、“其他辅助类业务项目”等。

重点关注干部队伍的培养工作，让干部能力与组织要求相匹配，培养方正证券特色的干部队伍，不断完善优化“高管领航班”、“现任干部巡航班”、“新任干部起航班及续航班”、“后备人才发展计划”。

系统打造优质高效的企业文化，力求实现“体系化、显性化”。通过调研、研讨等方式，逐步梳理与建设核心理念体系，规范员工行为准则，开展相应的企业文化建设配套项目，保障文化有效执行。

此外，继续开展“内部讲师培养项目”，完善课程体系、提高培训质量。同时开展内容丰富的通用技能类培训以满足广大员工的普遍培训需求。充分挖掘并发挥网络学习平台的优势，不断优化平台功能，丰富网络学习资源，设计及运营网络学习项目。

#### （四）经纪人情况

公司自 2009 年 6 月 24 日经湖南证监局批准实施证券经纪人制度起，民族证券自 2012 年 7 月 25 日经北京证监局批准实施证券经纪人制度起，分别稳妥有序地推动经纪人制度的实施工作。截至 2016 年 12 月 31 日，公司和民族证券所有证券营业部全部通过了当地监管部门的验收检查，获得证券经纪人制度实施许可，母公司共有 3,643 人签订了《证券经纪人委托合同》，民族证券共有 432 人签订了《证券经纪人委托合同》。

公司制定了证券经纪人管理的各项制度、业务流程及合同协议，包括：《方正证券股份有限公司证券经纪人管理办法》等一系列的内部控制制度明确了证券经纪人管理的组织架构，以及证券经纪人执业资格与管理、委托合同管理、档案管理、信息查询、培训管理、执业行为和规范、客户回访制度、投诉和纠纷处理机制、风险管理与责任追究、绩效考核和报告制度等实施证券经纪人制度所必需的制度和流程。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

根据《公司法》、《证券法》、《证券公司治理准则（试行）》、《上市公司治理准则》等法律、法规和规范性文件的规定，公司建立了由股东大会、董事会、监事会和公司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。根据相关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的规定，公司制定了《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《监事会议事规则》、《独立董事工作制度》、《董事会各专门委员会工作细则》、《执行委员会工作细则》、《董事会秘书工作制度》等制度，明确了股东大会、董事会、监事会、独立董事、董事会各专门委员会、总裁及董事会秘书的权责范围和工作程序，为公司法人治理结构的规范化运行提供了制度保证。

#### （一）股东和股东大会

股东大会是公司最高权力机构。公司股东大会的召集、召开及表决程序严格按照《公司法》、《上市公司股东大会规则》、《公司章程》、《股东大会议事规则》等法律、法规、规范性文件和公司制度的规定执行，并聘请律师进行现场鉴证，出具股东大会法律意见书。

公司控股股东及实际控制人能够严格按照相关法律、法规及《公司章程》的规定行使其享有的权利，不存在超越股东大会直接或间接干预公司决策和经营活动的行为，没有占用公司资金，也没有要求公司为其担保或为他人担保，在人员、资产、财务、机构和业务等方面与公司明确分离。公司能确保股东作为公司的所有者，享有法律、法规和《公司章程》规定的合法权利，确保所有股东，特别是中小股东享有平等地位。

#### （二）董事和董事会

董事会是公司决策机构，对股东大会负责，下设战略发展、风险控制、审计、提名、薪酬与考核五个专门委员会。董事会会议的召集、召开及表决程序严格按照《公司法》、《公司章程》、《董事会议事规则》等规定规范运作。

公司严格按照《公司法》、《公司章程》及相关法律法规、监管部门的要求，遵循公开、公平、公正的原则选举和变更董事，董事任免符合法定程序。董事会设董事 9 名，其中独立董事 3 名，符合中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》规定的董事会成员中至少包括三分之一独立董事的要求。公司董事均能严格遵守法律、法规及公司制度，维护公司和全体股东的最大利益，忠实、诚信、勤勉地履行职责；独立董事在董事会进行决策时起着监督制衡作用，独立、客观地维护中小股东权益。

#### （三）监事和监事会

监事会严格按照《公司法》、《公司章程》及相关法律法规的规定履行监督职责，监事会向股东大会负责。监事会会议的召集、召开及表决程序严格按照《公司法》、《公司章程》、《监事会议事规则》等的规定执行。

公司严格按照《公司法》、《公司章程》及相关法律法规、监管部门的要求，遵循公开、公平、公正的原则选举和变更监事，监事任免符合法定程序。公司监事会设监事 3 名，其中股东监事 2 名，职工监事 1 名。公司监事本着对全体股东负责的精神，对公司董事会和公司高级管理人员履行职责、公司财务的合法、合规性进行监督，并就有关事项向董事会和公司高级管理人员提出建议和改进意见。

#### （四）公司经营管理层

2012 年 11 月 26 日，公司第一届董事会第二十二次会议审议通过了《关于调整公司管理体制的议案》，决定设立执行委员会，执行委员会在修订后的公司章程获得股东大会审议通过，并报湖南证监局核准后正式成立。2013 年 2 月 18 日，公司收到湖南证监局《关于核准方正证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（湘证监机构字[2013]11 号），执行委员会正式成立。执行委员会作为落实公司董事会确定的经营方针和战略而设立的最高经营管理机构，在《公司章程》及《执行委员会工作细则》规定的职权范围内运作。公司现有执行委员会委员 7 人。

#### （五）信息披露

报告期内，公司严格按照《上市公司信息披露管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》等法律法规的要求，真实、准确、完整、及时地披露公司信息；公平对待所有股东，确保其享有平等的知情权；努力提高公司透明度，确保投资者能及时、准确、全面地获取公司信息。

#### （六）投资者关系

报告期内，借助投资者专线、信箱、网站等多渠道，通过现场调研等多种方式与投资者交流互动，及时解答投资者疑问，提升市场对公司的认知度。

#### （七）公司治理相关制度完善情况

为完善公司治理和内部控制，规范公司信息披露，公司制定并修订了《公司章程》、各专门委员会工作细则、董事会、监事会议事规则等，有效防范了内幕交易，健全了信息披露制度。

## 二、股东大会情况简介

报告期内，公司共召开 3 次股东大会，具体情况如下：

| 会议届次            | 召开日期      | 议案名称  | 决议情况       | 决议刊登指定网站的查询索引  | 决议刊登的披露日期 |
|-----------------|-----------|---|------------|----------------|-----------|
| 2016 年第一次临时股东大会 | 2016-2-19 | 1、关于解除赵大建董事职务的议案 2、关于解除杨克森监事职务的议案 3、关于购买董事、监事及高级管理人员责任险的议案 4、关于确定外部监事津贴标准的议案 5、关于补选第二届董事会董事的议案 6、关于补选第二届监事会监事（非职工代表监事）的议案   | 所有议案均已表决通过 | www.sse.com.cn | 2016-2-20 |
| 2015 年年度股东大会    | 2016-5-20 | 1、关于审议《方正证券 2015 年度董事会工作报告》的议案 2、关于审议《方正证券 2015 年度独立董事述职报告》的议案 3、关于审议《方正证券 2015 年度监事会工作报告》的议案 4、关于审议《方正证券 2015 年度报告》的议案 5、关于审议《方正证券 2015 年度财务决算报告》的议案 6、关于审议方正证券股 | 所有议案均已表决通过 | www.sse.com.cn | 2016-5-21 |

|                 |            |  |            |                |            |
|-----------------|------------|--|------------|----------------|------------|
|                 |            | 份有限公司 2015 年度利润分配预案的议案 7、关于聘任 2016 年度审计机构和内控审计机构的议案 8、关于审议《方正证券股份有限公司 2015 年度董事绩效考核及薪酬情况的专项说明》的议案 9、关于审议《方正证券股份有限公司 2015 年度监事绩效考核及薪酬情况的专项说明》的议案 10、关于审议《方正证券股份有限公司 2015 年度高级管理人员履职、薪酬及考核情况的专项说明》的议案 11、关于向各金融机构申请同业授信额度的议案 |            |                |            |
| 2016 年第二次临时股东大会 | 2016-11-24 | 1、关于修订公司章程的议案 2、关于选举第三届董事会董事（非独立董事）的议案 3、关于选举第三届董事会独立董事的议案 4、关于选举第三届监事会监事（非职工监事）的议案  | 所有议案均已表决通过 | www.sse.com.cn | 2016-11-25 |

### 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 | 以通讯方式参加会议次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自出席也未委托出席会议 | 出席股东大会的次数 |
| 高利     | 否      | 2          | 2      | 0           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 何其聪    | 否      | 6          | 6      | 0           | 0      | 0    | 否                   | 3         |
| 韦俊民    | 否      | 6          | 2      | 4           | 0      | 0    | 否                   | 3         |
| 汪辉文    | 否      | 8          | 5      | 3           | 0      | 0    | 否                   | 1         |
| 何亚刚    | 否      | 8          | 8      | 0           | 0      | 0    | 否                   | 2         |
| 赵大建（注） | 否      | 1          | 0      | 0           | 0      | 1    | 是                   | 0         |
| 车莉丽    | 否      | 7          | 1      | 6           | 0      | 0    | 否                   | 1         |
| 陈晓龙    | 否      | 6          | 0      | 6           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 廖航     | 否      | 2          | 2      | 0           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 徐昂杨    | 否      | 2          | 1      | 0           | 1      | 0    | 否                   | 0         |
| 叶林     | 是      | 8          | 3      | 5           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 黄卫平    | 是      | 6          | 2      | 1           | 3      | 0    | 否                   | 0         |
| 赵志军    | 是      | 6          | 1      | 5           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 李明高    | 是      | 2          | 2      | 0           | 0      | 0    | 否                   | 0         |
| 胡廷华    | 是      | 2          | 0      | 2           | 0      | 0    | 否                   | 0         |

注：公司董事赵大建先生连续超过 2 次未亲自出席公司董事会，也未委托其他董事出席并表决，根据《公司章程》的规定，上述情形应视为赵大建先生不能履行董事职责，股东大会应当予以撤换。公司于 2016 年 2 月 19 日召开“2016 年第一次临时股东大会”，会议通过了关于解除赵大建董事职务的议案。

#### (二) 董事会召开情况

|                |   |
|----------------|---|
| 年内召开董事会会议次数    | 8 |
| 其中：现场会议次数      | 0 |
| 通讯方式召开会议次数     | 0 |
| 现场结合通讯方式召开会议次数 | 8 |

| 会议届次          | 召开日期     | 决议内容  | 决议刊登的信息披露报纸                  | 决议刊登的信息披露日期 |
|---------------|----------|---|------------------------------|-------------|
| 第二届董事会第二十六次会议 | 2016-2-1 | 1、关于聘任首席风险官的议案 2、关于聘任财务负责人的议案 3、关于解除赵大建董事职务的议案 4、关于补选第二届董事会董事的议案 5、关于购买董事、监事及高级管理人员责任 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2016-2-2    |

|               |            |   |        |            |
|---------------|------------|---|--------|------------|
|               |            | 险的议案 6、关于方正中期期货有限公司改制并挂牌的议案<br>7、关于召开 2016 年第一次临时股东大会的议案  | 《证券日报》 |            |
| 第二届董事会第二十七次会议 | 2016-4-28  | 1、方正证券股份有限公司 2015 年度董事会工作报告 2、方正证券股份有限公司 2015 年度执行委员会工作报告 3、方正证券股份有限公司 2015 年度独立董事述职报告 4、方正证券股份有限公司 2015 年年度报告 5、方正证券股份有限公司 2015 年度财务决算报告 6、方正证券股份有限公司 2015 年度合规报告 7、方正证券股份有限公司 2015 年度内部控制自我评价报告 8、方正证券股份有限公司 2015 年度社会责任报告 9、方正证券股份有限公司 2015 年度董事绩效考核及薪酬情况的专项说明 10、方正证券股份有限公司 2015 年度高级管理人员履职、薪酬及考核情况的专项说明 11、关于向各金融机构申请同业授信额度的议案 12、方正证券股份有限公司 2015 年度利润分配预案 13、关于聘任 2016 年度审计机构和内控审计机构的议案 14、关于签署日常关联交易框架协议暨确认 2015 年度日常关联交易金额及预计 2016 年度日常关联交易金额的议案 15、方正证券股份有限公司 2016 年第一季度报告 16、关于补选董事会审计委员会委员的议案 17、关于增补执行委员会委员的议案 18、关于确认公司高级管理人员 2015 年绩效考核结果的议案 19、关于赵亚男不再担任公司副总裁的议案 20、关于召开 2015 年年度股东大会的议案 |        | 2016-4-29  |
| 第二届董事会第二十八次会议 | 2016-7-5   | 1、关于确定高级管理人员 2015 年度绩效奖金的议案 2、关于确定高级管理人员 2016 年固定工资调整结果的议案 3、关于聘任姜志军担任副总裁的议案 4、关于公司 2016 年度自营投资额度的议案  |        | 2016-7-6   |
| 第二届董事会第二十九次会议 | 2016-8-29  | 1、方正证券股份有限公司 2016 年半年度报告 2、方正证券股份有限公司 2016 年中期合规报告 3、关于撤销北京证券自营分公司的议案 4、关于增加方正证券（香港）金融控股有限公司注册资本的议案   |        | 2016-8-30  |
| 第二届董事会第三十次会议  | 2016-10-28 | 方正证券股份有限公司 2016 年第三季度报告   |        |            |
| 第二届董事会第三十一次会议 | 2016-11-7  | 1、关于修订董事会专门委员会工作细则的议案 2、关于修订公司章程的议案 3、关于推选第三届董事会董事候选人的议案 4、关于陈锐不再担任副总裁的议案 5、关于召开 2016 年第二次临时股东大会的议案   |        | 2016-11-8  |
| 第三届董事会第一次会议   | 2016-12-2  | 1、关于选举董事长的议案 2、关于选举董事会专门委员会成员的议案  |        | 2016-12-3  |
| 第三届董事会第二次会议   | 2016-12-21 | 1、关于聘任总裁的议案 2、关于聘任执行委员会委员的议案 3、关于聘任合规总监的议案 4、关于聘任董事会秘书的议案 5、关于修订信息披露事务管理制度的议案 6、关于修订投资者关系管理制度的议案 7、关于设立扶贫工作部和战略规划部的议案   |        | 2016-12-22 |

(三) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

| 独立董事姓名 | 独立董事提出异议的有关事项内容   | 异议的内容   | 是否被采纳 | 备注          |
|--------|---|---|-------|-------------|
| 胡廷华    | 《关于聘任总裁的议案》（反对票）<br>《关于聘任执行委员会委员的议案》（反对票）<br>《关于聘任合规总监的议案》（反对票） | 本人自 2016 年 11 月 24 日当选出任公司独立董事至今，公司已连续收到监管机构送达的一份行政处罚，两份监管函；过去的一年，公司的评级也连降六级。虽然发生了股东纠纷等特殊事件，但上述行政处罚和监管函中披露的问题均发生在公司管理层面，与股东纠纷关系不大，问题的根本在于公司内部治理缺失。本人注意到本次提名的人选均为原管理团队，职务也没有变化，本人对这种换汤不换药的做法不认可。因此，本人认为，鉴于公司治理层面存在的问题，公司的管理层应当重新组建，去芜存菁，大胆提拔有能力的员工，引进新的专业人才，优化公司管理架构，改正公司治理中存在的问题，方能维护股东，特 | 不适用   | 第三届董事会第二次会议 |

|  |                     |                       |  |  |
|--|---------------------|-----------------------|--|--|
|  | 《关于聘任董事会秘书的议案》（反对票） | 别是中小股东的权益。鉴于此，本人投反对票。 |  |  |
|--|---------------------|-----------------------|--|--|

#### 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

报告期内，公司董事会各专门委员会按照各自工作规则的规定，以认真负责、勤勉诚信的态度忠实履行各自职责。董事会各专门委员会为完善公司治理结构、提高公司管理水平、促进公司发展等方面起到了积极的作用。

报告期内，第二届董事会共召开董事会专门委员会 14 次，其中风险控制委员会 2 次，审计委员会 5 次、提名委员会 5 次、薪酬与考核委员会 2 次。作为董事会专门委员会委员，除赵大建董事缺席 1 次审计委员会会议外，其他董事全部参加了应出席的董事会专门委员会会议。

报告期内，第三届董事会共召开董事会专门委员会 2 次，其中提名委员会 2 次。董事会专门委员会委员全部参加了应出席的董事会专门委员会会议。

#### 五、监事履行职责情况

##### （一）监事参加监事会和列席股东大会、董事会的情况

2016 年度，公司监事列席了股东大会所有会议，对股东大会的召集召开程序、表决程序进行了监督，参与股东大会的计票和监票，对股东大会表决结果进行了监督。

2016 年度，公司监事列席了公司董事会所有会议，对董事会议案进行了审查，对董事会的召集召开程序、表决程序、表决结果进行了监督。

监事会对报告期内的监督事项无异议。

2016 年度，公司监事参加监事会情况：

| 监事姓名   | 本年应参加监事会次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加会议次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自出席也未委托出席会议 |
|--------|------------|--------|-------------|--------|------|---------------------|
| 陆琦     | 5          | 5      | 0           | 0      | 0    | 否                   |
| 雍苹     | 1          | 1      | 0           | 0      | 0    | 否                   |
| 杨克森（注） | 1          | 0      | 0           | 0      | 1    | 是                   |
| 徐建伟    | 4          | 4      | 0           | 0      | 0    | 否                   |
| 马楠     | 1          | 1      | 0           | 0      | 0    | 否                   |
| 郑华     | 6          | 6      | 0           | 0      | 0    | 否                   |

注：公司监事杨克森女士连续超过 2 次未亲自出席公司监事会，也未委托其他监事代为出席并表决，根据《公司章程》的规定，上述情形应视为杨克森女士不能履行监事职责，股东大会应当予以撤换。公司于 2016 年 2 月 19 日召开“2016 年第一次临时股东大会”，会议通过了关于解除杨克森监事职务的议案。

##### （二）监事会召开情况

| 会议届次         | 召开日期     | 决议内容   | 决议刊登的信息披露报纸                  | 决议刊登的信息披露日期 |
|--------------|----------|--|------------------------------|-------------|
| 第二届监事会第十四次会议 | 2016-2-1 | 1、关于解除杨克森监事职务的议案 2、关于补选第二届监事会监事候选人（非职工代表监事）的议案 3、关于确定外部监事津贴标准的议案 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2016-2-2    |

|              |            |  |        |            |
|--------------|------------|--|--------|------------|
| 第二届监事会第十五次会议 | 2016-4-28  | 1、方正证券股份有限公司 2015 年度监事会工作报告 2、方正证券股份有限公司 2015 年年度报告 3、方正证券股份有限公司 2015 年度财务决算报告 4、方正证券股份有限公司 2015 年度合规报告 5、方正证券股份有限公司 2015 年度内部控制自我评价报告 6、方正证券股份有限公司 2015 年度社会责任报告 7、方正证券股份有限公司 2015 年度监事绩效考核及薪酬情况的专项说明 8、方正证券股份有限公司 2016 年第一季度报告 | 《证券日报》 | 2016-4-29  |
| 第二届监事会第十六次会议 | 2016-8-29  | 1、方正证券股份有限公司 2016 年半年度报告 2、方正证券股份有限公司 2016 年中期合规报告   |        | 2016-8-30  |
| 第二届监事会第十七次会议 | 2016-10-27 | 方正证券股份有限公司第三季度报告   |        | 2016-10-28 |
| 第二届监事会第十八次会议 | 2016-11-7  | 关于推选第三届监事会监事候选人（非职工代表监事）的议案  |        | 2016-11-8  |
| 第三届监事会第一次会议  | 2016-12-2  | 关于选举监事会主席的议案   |        | 2016-12-3  |

## 六、公司与控股股东在业务、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

适用 不适用

## 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

（一）业绩考评：年初公司高级管理人员根据公司战略目标及年度经营计划明确个人年度关键业绩指标，年终由董事会薪酬与考核委员会进行综合考评。

（二）激励情况：在国家现有法律框架内，公司高级管理人员实行年薪制。董事会根据公司及高级管理人员经营业绩情况确定相应的年度薪酬情况。

（三）股权激励：报告期内，公司未实施股权激励。

## 八、内部控制评价报告

### （一）董事会关于内部控制责任的声明

董事会按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。经理层负责组织领导企业内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目标是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进实现发展战略。由于内部控制存在的固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或对控制政策和程序遵循的程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。

### （二）建立财务报告内部控制的依据

公司依据企业内部控制规范体系结合公司内部控制评价办法，组织开展内部控制评价工作。公司董事会根据企业内部控制规范体系对重大缺陷、重要缺陷和一般缺陷的认定要求，结合公司规模、行业特征、风险偏好和风险承受度等因素，区分财务报告内部控制和非财务报告内部控制，研究确定了适用于本公司的内部控制缺陷具体认定标准，并与以往年度保持一致。

### （三）内部控制体系建设情况

详见公司于2017年3月30日随本年度报告在上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)上披露的《内部控制评价报告》。

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司2016年度的内部控制进行了审计，并出具了标准无保留的《方正证券股份有限公司2016年度内部控制审计报告》，认为公司于2016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。该报告于2017年3月30日随本年度报告在上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)上披露。

## 十、公司合规管理体系建设情况说明

### （一）合规管理体系建设

公司一直重视合规管理体系的建设。报告期内，公司按照监管部门和《公司章程》的规定，进一步完善了合规管理体系，加强了新业务、证券自营和证券资产管理业务、员工执业行为的合规管理工作，启用信息隔离墙系统，强化合规考核，对发现的违法违规行为及时查处，公司合规管理工作有效开展。

2016年，公司在建立合规管理体系、落实合规管理制度、保障合规运行等方面主要开展了如下工作：

#### 1、加强新业务的合规管理

随着行业创新转型加速，公司业务种类（包括产品和服务）不断增加、业务模式也在不断进行变化和调整。2016年全年，公司合规部门按照法律法规、监管规定对公司新业务、新产品进行了合规审核；制定了包括决策审批、业务管理、合规管理与风险控制、客户资质标准、客户适当性管理、客户资质审核流程、客户回访、清算管理、应急处理等一系列内部控制制度以及协议书、风险揭示书等法律文件；建立了新业务的风险监控系统，对新业务进行实时监控，及时处理系统提示的风险预警等。

#### 2、加强对证券自营和资产管理业务的合规管理

公司资管分公司、自营分公司设立风控合规岗，对资管业务、自营业务进行合规检查。公司法律合规部对资产管理决策委员会会议相关议案通过发表建议进行合规与风险控制；对自营公

司拟订的拟提交证券投资决策委员会审议的议案进行了事前审核，并对其拟订的业务制度、非标产品投资、证券池调整、量化投资项目等议案内容提出风险管理建议。

### 3、做好信息隔离工作

公司严格落实证券监管部门、中国证券业协会有关证券公司信息隔离合规管理的要求，结合公司经营管理的实际情况，通过信息隔离墙系统，根据隔离规则对证券自营、资产管理、研究业务等可能存在利益冲突的业务进行有效的限制或披露。同时严格执行跨墙审批，防止敏感信息不当流动，加强研究报告发布前的合规审核，防范利益冲突。

### 4、严格落实合规考核制度

公司法律合规部会同稽核审计部、人力资源部、经纪业务管理部等部门，根据公司《董事、监事及高级管理人员薪酬与考核管理办法》、《综合考评管理制度》和《经纪业务考核办法》的规定，对公司经营层高管、总部各部门、分支机构进行了 2016 年度的合规专项考核，考核结果纳入公司年度绩效考评。

### 5、切实、全面履行反洗钱义务

公司将风险防控作为反洗钱工作的核心，全面落实反洗钱客户身份识别、客户风险等级划分、可疑交易的识别和分析、反洗钱宣传与培训等反洗钱工作的合规性要求；公司建立了反洗钱监测中心，并优化了大额和可疑交易报告工作模式；同时结合新业务的开展，同步进行了洗钱风险评估，不断完善反洗钱内控措施及增强自身对洗钱风险的防控能力，搭建了一个有效防范洗钱风险、更加符合我公司业务和客户特点的反洗钱内控体系。

#### （二）合规检查情况

报告期内公司法律合规部根据相关监管机构、自律组织的要求以及公司合规管理的需要，开展了对总部各业务部门以及分支机构的合规检查工作。法律合规部组织了对公司所有业务投资者适当性管理情况、金融工程部量化投资策略、研究所发布证券研究报告业务事宜、对2015年“两个加强、两个遏制”专项检查反馈问题的整改情况、资管分公司资管业务开展情况、营业部上网行为管理制度的落实情况、分支机构员工（经纪人）证券投资行为情况等方面的合规检查。为防范业务整合过程中的合规风险，法律合规部还针对公司与民族证券整合过程中的问题，就公司为民族证券提供相关支持和服务事项进行了专项合规检查。

公司法律合规部还根据经纪业务业务量居前的营业部（融资融券、金融产品代销、中间介绍业务交易量排名居前）、近三年未进行合规检查的营业部的原则，对16家营业部进行了现场合规检查。

针对上述合规检查发现的问题，法律合规部均督促相关部门及分支机构及时进行了整改。

#### （三）稽核审计工作开展情况

报告期内，公司稽核审计部开展了常规稽核、离任审计、专项稽核、工程预结算审计等稽核审计工作。常规稽核是对被稽核单位经营活动及内部管理情况进行全面稽核，稽核范围包括被稽核单位业务管理、财务管理、人事管理、行政综合管理、信息技术管理、风险控制等方面，重点

关注内部控制制度建立和执行情况、风险管理情况。离任审计是对被审计单位负责人任期内的经营目标完成情况、内部控制的有效性和适当性进行审计，对负责人任期内的履职情况及负有的经济责任做出评价。专项稽核是根据公司或证券监管部门要求，针对特定事项进行的专项检查、对员工的违法违规行为以及投诉和举报进行的专项调查。工程预结算审计是指通过组织建设工程项目的预算与结算审计，审查建设工程项目建设过程的合法合规性，评价工程造价的合理性和准确性。

报告期内，公司稽核审计部完成常规稽核 72 项，其中营业部常规稽核 67 项、总部常规稽核 5 项（包括研究所、自营分公司、交易业务部、金融工程部和民族证券投资部）；完成离任审计 76 项，其中营业部负责人离任审计 61 项、总部部门负责人离任审计 8 项、高管人员离任审计 7 项；完成专项稽核 33 项，其中营业部专项稽核 18 项，总部专项稽核 15 项（涉及资管分公司、信息技术中心、投资银行部、研究所、市场发展部、金融工程部等部门）；完成对全资子公司方正和生的审计；完成工程预结算审计 211 项。报告期内，被稽核审计单位均在规定的时间内根据稽核审计报告出具的整改建议对存在的问题进行了整改。稽核审计部开展公司内部控制评价工作，报告期内，根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，不存在财务报告内部控制重大缺陷，根据公司非财务报告内部控制重大缺陷认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷。

## 第十节 公司债券相关情况

### 一、公司债券基本情况

(一) 本公司无公开发行债券。

(二) 非公开发行债券情况。

单位：万元 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   | 交易场所                |
|---------------------------------------|----------|--------|------------|------------|-----------|-------|--|---------------------|
| 方正证券股份有限公司 2014 年次级债券                 | 14 方正债   | 123401 | 2014/4/28  | 2019/4/28  | 300,000   | 7.00% | 采用单利计息，不计复利。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<br>证券<br>交易<br>所 |
| 方正证券股份有限公司 2015 年度第一期次级债券             | 15 方正 01 | 123222 | 2015/4/10  | 2017/4/10  | 280,000   | 6.00% | 采用单利计息，不计复利。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。                        |                     |
| 方正证券股份有限公司 2015 年度第二期次级债券             | 15 方正 02 | 123078 | 2015/5/18  | 2017/5/18  | 1,000,000 | 6.20% | 采用单利计息，不计复利。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。                        |                     |
| 方正证券股份有限公司次级债券（2015 年第三期）             | 15 方正 03 | 125977 | 2015/6/29  | 2016/6/29  | 1,000,000 | 5.60% | 采用单利按年计息，不计复利。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。已于 2016 年 6 月 29 日摘牌。 |                     |
| 方正证券股份有限公司 2015 年第二期短期公司债券            | 15 方正 D2 | 125023 | 2015/4/23  | 2016/4/23  | 180,000   | 5.90% | 到期一次还本，利息随本金一起支付。已于 2016 年 4 月 23 日摘牌。                             |                     |
| 方正证券股份有限公司次级债券（2016 年第一期）             | 16 方正 C1 | 135241 | 2016/2/19  | 2021/2/19  | 1,000,000 | 4.43% | 采用单利按年计息，不计复利。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。                      |                     |
| 方正证券股份有限公司 2016 年非公开发行次级债券（第二期）       | 16 方正 C2 | 145111 | 2016/10/28 | 2019/10/28 | 300,000   | 3.80% | 采用单利按年计息，不计复利。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。                      |                     |
| 方正证券股份有限公司 2016 年非公开发行证券公司短期公司债券（第一期） | 16 方正 D1 | 145178 | 2016/11/18 | 2017/11/18 | 600,000   | 3.70% | 到期一次还本，利息随本金一起支付。  |                     |

### 公司债券投资者适当性安排

上述债券投资者适当性安排均为面向合格投资者非公开发行。

### 公司债券付息兑付情况

2016 年，公司对“15 方正 03”行使了发行人赎回选择权，于 2016 年 6 月 29 日全部赎回；“15 方正 D2”于 2016 年 4 月 23 日完成到期兑付；“14 方正债”、“15 方正 01”、“15 方正 02”已按期支付利息；“16 方正 C1”、“16 方正 C2”、“16 方正 D1”2016 年内无兑息期。

### 公司债券附权情况

公司发行的“14 方正债”、“15 方正 01”、“15 方正 02”、“15 方正 D2”、“16 方正 C2”、“16 方正 D1”无发行人或者投资者选择权条款、可交换条款、提前偿还条款等特殊条款；“15 方正 03”存续第一年末附发行人赎回选择权，公司已于 2016 年 6 月 29 日全部赎回；“16 方正 C1”存续第三年末附发行人赎回选择权。

## 二、公司债券受托管理联系人及联系方式

|              |        |                               |
|--------------|--------|-------------------------------|
| 中国民族证券有限责任公司 | 办公地址   | 北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 41 楼 |
|              | 联系人    | 宋小坤                           |
|              | 联系电话   | 010-59355630                  |
|              | 受托管理债券 | 15 方正 03、16 方正 C1             |
| 万和证券股份有限公司   | 办公地址   | 深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 20 层  |
|              | 联系人    | 莫汝晨                           |
|              | 联系电话   | 0755-82830333-352             |
|              | 受托管理债券 | 16 方正 C2、16 方正 D1             |

## 三、公司债券募集资金使用情况

公司发行的次级债券和短期公司债券募集资金扣除发行等相关费用后，全部用于补充公司营运资金，与募集说明书约定的资金用途一致。

## 四、公司债券评级情况

公司 2016 年存续的次级债券和短期公司债券均未进行评级安排。

## 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

报告期内，公司按时履行各期债券年度付息及到期还本付息义务，公司偿债能力良好，偿债资金主要来源于公司资本积累、日常的盈利积累及经营活动所产生的现金流等。

## 六、公司债券持有人会议召开情况

报告期内，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

“15 方正 03”、“16 方正 C1”两期债券聘请民族证券为债券受托管理人，“16 方正 C2”、“16 方正 D1”聘请万和证券股份有限公司为债券受托管理人。公司与上述债券受托管理人均签订了《债券受托管理协议》与《债券持有人会议规则》。

“16 方正 C1”、“16 方正 C2”和“16 方正 D1”的 2016 年度债券受托管理报告将于 2017 年 6 月 30 日前在上海证券交易所网站披露。

## 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          | 2016 年           | 2015 年           | 本期比上年同期增减(%) | 变动原因               |
|---------------|------------------|------------------|--------------|--------------------|
| 息税折旧摊销前利润     | 6,646,502,856.85 | 9,043,766,713.41 | -26.51       | 主要为税前利润减少所致        |
| 流动比率          | 2.16             | 2.47             | -12.55       |                    |
| 速动比率          | 2.16             | 2.47             | -12.55       |                    |
| 资产负债率         | 70.21%           | 66.86%           | 增加 3.35 个百分点 |                    |
| EBITDA 全部债务比  | 7.79%            | 12.62%           | 减少 4.83 个百分点 | 主要为税前利润减少所致        |
| 利息保障倍数        | 1.97             | 2.58             | -23.64       |                    |
| 现金利息保障倍数      | -6.09            | -2.68            | 不适用          | 主要为经营活动产生的现金流为负数所致 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.03             | 2.63             | -22.81       |                    |
| 贷款偿还率         | 100%             | 100%             | -            |                    |
| 利息偿付率         | 100%             | 100%             | -            |                    |

## 九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

2016 年，公司其他债务融资工具包括：同业拆借、债券买断正回购、债券质押式正回购、质押式报价回购、融资业务债权收益权转让、股票质押回购式债权收益权转让、收益凭证等。公司各项融资均按时支付本金及利息。

## 十、公司报告期内的银行授信情况

截至报告期末，公司共计获得 77 家银行授信，授信总额为 1,348.76 亿元，已使用额度 114.42 亿元，剩余可用额度 1,234.34 亿元。

## 十一、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

报告期内，公司执行了各期债券募集说明书中的承诺。

- (一) 募集资金按照约定用途使用；
- (二) 按期还本付息；
- (三) 在约定的场所和时间定期披露公司信息。

## 十二、公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

公司因存在未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会《行政处罚决定书》。公司已按照监管要求完成了整改；公司对涉及此案所得和处罚金额已于 2015 年度全额计入预计负债，因此，本次《行政处罚决定书》对公司 2016 年及未来财务无重大影响，亦不会对整体偿债能力产生重大不利影响。

## 第十一节 财务报告

- 一、审计报告（附后）
- 二、财务报表（附后）
- 三、财务报表附注（附后）

## 第十二节 备查文件目录

- 一、载有法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的会计报表。
- 二、载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。
- 三、报告期内在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的原稿。

方正证券股份有限公司董事会

董事长：高利

二〇一七年三月三十日

## 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

| 日期         | 批复标题及文号  |
|------------|--|
| 2016-02-19 | 《车莉丽证券公司董事任职资格申请的批复》（湘证监机构字[2016]4号）             |
| 2016-02-20 | 《胡颖证券公司监事任职资格申请的批复》（湘证监机构字[2016]5号）              |
| 2016-02-21 | 《徐建伟证券公司监事任职资格申请的批复》（湘证监机构字[2016]6号）             |
| 2016-07-18 | 《关于方正证券公司姜志军高管任职资格申请的批复》（湘证监机构字[2016]27号）        |
| 2016-11-18 | 《关于胡廷华证券公司独立董事任职资格的批复》（湘证监机构字[2016]47号）          |
| 2016-11-18 | 《关于徐昂杨证券公司董事任职资格的批复》（湘证监机构字[2016]48号）            |
| 2016-11-18 | 《关于李明高证券公司独立董事任职资格的批复》（湘证监机构字[2016]49号）          |
| 2016-11-18 | 《关于雍莘证券公司监事任职资格的批复》（湘证监机构字[2016]50号）             |
| 2016-11-18 | 《关于廖航证券公司董事任职资格的批复》（湘证监机构字[2016]51号）             |
| 2016-11-09 | 《关于同意开通财富证券等会员单位深港通下港股通业务交易权限的通知》（深证会[2016]355号） |
| 2016-12-21 | 《关于核准方正证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（湘证监机构字[2016]56号）   |

### 二、 监管部门对公司的分类结果

2014年A类A级，2015年A类A级，2016年C类C级。

附录一 分支机构名录

**区域分公司**

| 序号 | 名称              | 地址   | 联系电话          |
|----|-----------------|--|---------------|
| 1  | 方正证券股份有限公司浙江分公司 | 杭州市延安路 398 号二轻大厦 A 楼 11 层                          | 0571-87782578 |
| 2  | 方正证券股份有限公司北京分公司 | 北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 10 层 1001B                        | 010-59355478  |
| 3  | 方正证券股份有限公司河南分公司 | 郑州市二七区嵩山南路 81 号机械研究所单身职工公寓 3 层                     | 0371-67723518 |
| 4  | 方正证券股份有限公司江西分公司 | 江西省南昌市东湖区南京西路 219 号京西大厦 5 楼                        | 0791-86362081 |
| 5  | 方正证券股份有限公司陕西分公司 | 西安市碑林区南大街粉巷三号王子大厦 9 层 919 室                        | 029-68661958  |
| 6  | 方正证券股份有限公司重庆分公司 | 重庆市渝北区龙溪街道新南路 9 号碧海金都 1 幢 2-1                      | 023-88505293  |
| 7  | 方正证券股份有限公司天津分公司 | 天津市和平区新华路 166 号海珠大厦三层 356、366                      | 022-23141888  |
| 8  | 方正证券股份有限公司湖北分公司 | 武昌区中北路与东沙大道交汇处武汉中央文化区 K1 地块一期一区 K1-2 幢 20 层 9、10 号 | 027-87257133  |
| 9  | 方正证券股份有限公司广东分公司 | 广州市天河区兴盛路 12 号 334 房                               | 020-38029500  |
| 10 | 方正证券股份有限公司云南分公司 | 云南省昆明市五华区三市街柏联广场 14 层 A-15 写字楼                     | 0871-63601038 |

## 证券营业部（母公司）

| 序号 | 区域  | 营业部名称                   | 地址                                      | 联系电话          |
|----|-----|-------------------------|---|---------------|
| 1  | 北京  | 方正证券股份有限公司北京阜外大街证券营业部   | 北京市西城区阜外大街甲 34 号                        | 010-68518581  |
| 2  |     | 方正证券股份有限公司北京玉带河东街证券营业部  | 北京市通州区玉带河东街 105 号 1-2 层全部               | 010-60567752  |
| 3  |     | 方正证券股份有限公司北京和平里东街证券营业部  | 北京东城区和平里东街 6 区 8 号                      | 010-84216177  |
| 4  |     | 方正证券股份有限公司北京回龙观西大街证券营业部 | 北京市昌平区回龙观镇回龙观西大街 18 号 1 段 1-102、103     | 010-57766988  |
| 5  | 上海  | 方正证券股份有限公司上海延安西路证券营业部   | 上海市延安西路 719 号 3 层                       | 021-62103436  |
| 6  |     | 方正证券股份有限公司上海南奉公路证券营业部   | 上海市奉贤区南奉公路 7777 号 6 层 717 室             | 021-61180677  |
| 7  |     | 方正证券股份有限公司上海杨高北路证券营业部   | 中国（上海）自由贸易试验区杨高北路 2001 号第三层 H 部位        | 021-62118029  |
| 8  |     | 方正证券股份有限公司上海保定路证券营业部    | 上海市虹口区保定路 631 号 1-2 层                   | 021-61436322  |
| 9  |     | 方正证券股份有限公司上海川南奉公路证券营业部  | 上海市奉贤区奉城镇川南奉公路 9876 号 三楼                | 021-67170326  |
| 10 |     | 方正证券股份有限公司上海西藏南路证券营业部   | 上海市黄浦区西藏南路 1208 号 10 楼 F 座              | 021-61190236  |
| 11 | 广东省 | 方正证券股份有限公司深圳福中路证券营业部    | 深圳市福田区福中路 60 号依迪综合楼西三楼                  | 0755-83248817 |
| 12 |     | 方正证券股份有限公司深圳怡景路证券营业部    | 深圳市罗湖区怡景路 11 号峰景台大厦 2 层                 | 0755-33220282 |
| 13 |     | 方正证券股份有限公司深圳福永大道证券营业部   | 深圳市宝安区福永街道福永大道深彩大厦三楼                    | 0755-27330822 |
| 14 |     | 方正证券股份有限公司深圳布沙路证券营业部    | 深圳市龙岗区南湾街道布沙路玉岭花园 A2 栋 A201             | 0755-25993855 |
| 15 |     | 方正证券股份有限公司深圳别墅路证券营业部    | 深圳市光明新区公明办事处别墅路 13 号 2 楼 A              | 0755-89496688 |
| 16 |     | 方正证券股份有限公司深圳华侨城证券营业部    | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 804                       | 0755-25220988 |
| 17 |     | 方正证券股份有限公司广州兴盛路证券营业部    | 广东省广州市天河区兴盛路 12 号 3 楼                   | 020-38029658  |
| 18 |     | 方正证券股份有限公司广州站前路证券营业部    | 广州市越秀区站前路 197 号 301、302 室               | 020-28353161  |
| 19 |     | 方正证券股份有限公司广州水榕路证券营业部    | 广州市海珠区水榕路 161 号 B101 商铺                 | 020-34466602  |
| 20 |     | 方正证券股份有限公司广州狮岭大道证券营业部   | 广州市花都区狮岭镇度假村专用道 1 号一楼东侧 01 房            | 020-37760332  |
| 21 |     | 方正证券股份有限公司广州体育东路证券营业部   | 广州市天河区体育东路 122 号之一 1401-1403 室（仅限办公用途）  | 020-87572213  |
| 22 |     | 方正证券股份有限公司东莞万道路证券营业部    | 广东省东莞市万江区新城新区万道路华南摩尔 J 区三元盈晖大厦二层 8 号 商铺 | 0769-28638999 |
| 23 |     | 方正证券股份有限公司东莞虎门大道证券营业部   | 东莞市虎门镇都市华庭 401A 号                       | 0769-86093388 |
| 24 |     | 方正证券股份有限公司惠州南坛北路证券营业部   | 惠州市南坛北路 27 号滨江苑 A 栋二层 2 号写字楼            | 0752-2168751  |
| 25 | 浙江省 | 方正证券股份有限公司杭州中河中路证券营业部   | 浙江省杭州市中河中路 198 号 12、13、14 层             | 0571-87782338 |
| 26 |     | 方正证券股份有限公司杭州保俶路证券营业部    | 浙江省杭州市保俶路 221 号                         | 0571-87960160 |

|    |                        |                                      |               |
|----|------------------------|--------------------------------------|---------------|
| 27 | 方正证券股份有限公司杭州延安路证券营业部   | 浙江省杭州市延安路 398 号                      | 0571-87088645 |
| 28 | 方正证券股份有限公司杭州南山路证券营业部   | 浙江省杭州市南山路 258-1 号 4、5 层              | 0571-87701810 |
| 29 | 方正证券股份有限公司杭州庆春东路证券营业部  | 浙江省杭州市江干区庆春东路 68-1 号 201 室           | 0571-87797068 |
| 30 | 方正证券股份有限公司杭州杭海路证券营业部   | 浙江省杭州市杭海路 888 号永和大厦 B 座 101、301      | 0571-86759777 |
| 31 | 方正证券股份有限公司杭州下沙证券营业部    | 浙江省杭州经济技术开发区 4 号大街 15 号西子阳光星城 2 幢五楼  | 0571-86849877 |
| 32 | 方正证券股份有限公司杭州滨江通和路证券营业部 | 杭州市滨江区通和路 68 号 4 楼 B 区 403 室         | 0571-56565608 |
| 33 | 方正证券股份有限公司杭州萧山金山路证券营业部 | 萧山区北干街道金山路 125 号                     | 0571-57576001 |
| 34 | 方正证券股份有限公司衢州龙游人民路证券营业部 | 龙游县龙洲街道人民路 131、133 号                 | 0570-7089668  |
| 35 | 方正证券股份有限公司台州解放路证券营业部   | 浙江省台州市椒江区解放南路 36 号                   | 0576-88800577 |
| 36 | 方正证券股份有限公司玉环长治路证券营业部   | 浙江省玉环县玉城街道长治路 98 号                   | 0576-81717280 |
| 37 | 方正证券股份有限公司三门中海路证券营业部   | 三门县海游镇中海路 6 号                        | 0576-83309268 |
| 38 | 方正证券股份有限公司仙居穿城北路证券营业部  | 仙居县安洲街道穿城北路 1 号                      | 0576-87787757 |
| 39 | 方正证券股份有限公司天台寒山路证券营业部   | 天台县赤城街道寒山路 202 号                     | 0576-89509033 |
| 40 | 方正证券股份有限公司金华光南路证券营业部   | 浙江省金华市金东区多湖街道光南路 179 号、181 号         | 0579-82204011 |
| 41 | 方正证券股份有限公司台州邮电路证券营业部   | 浙江省台州市路桥区邮电路 193 号 1 楼、3 楼           | 0576-82501133 |
| 42 | 方正证券股份有限公司临海巾山东路证券营业部  | 临海市古城街道巾山东路 176 号                    | 0576-85125928 |
| 43 | 方正证券股份有限公司台州黄岩洞天路证券营业部 | 台州市黄岩区西城街道洞天路 142 号                  | 0576-84056633 |
| 44 | 方正证券股份有限公司台州市府大道证券营业部  | 台州市市府大道 199 号、201 号、203 号第一层         | 0576-88199787 |
| 45 | 方正证券股份有限公司温岭泽楚路证券营业部   | 浙江省温岭市泽国镇泽楚路 273 号 1-4 层             | 0576-86446370 |
| 46 | 方正证券股份有限公司温岭安平东路证券营业部  | 温岭市大溪镇安平东路 330 号、332 号               | 0576-86423356 |
| 47 | 方正证券股份有限公司温岭万昌中路证券营业部  | 温岭市太平街道万昌中路 513 号                    | 0576-86506363 |
| 48 | 方正证券股份有限公司温州小南路证券营业部   | 浙江省温州市小南路 1 号五洲大厦                    | 0577-68873771 |
| 49 | 方正证券股份有限公司温州永中西路证券营业部  | 温州市龙湾区永中街道万鑫锦园 1-6 幢 121-1 室、121-2 室 | 0577-88200116 |
| 50 | 方正证券股份有限公司温州丽岙中路证券营业部  | 温州市瓯海区丽岙街道茶堂花苑 B 幢 113-114 号         | 0577-86999811 |
| 51 | 方正证券股份有限公司温州黎明西路证券营业部  | 温州市黎明西路 65 号-103 号星河大楼 C 座二层         | 0577-88333585 |
| 52 | 方正证券股份有限公司苍南龙港大道证券营业部  | 苍南县龙港镇龙港大道红旗大厦 2 层                   | 0577-68618900 |
| 53 | 方正证券股份有限公司瑞安安阳大道证券营业部  | 瑞安市安阳街道安阳大道 1123、1125、1127、1129 号    | 0577-25620888 |
| 54 | 方正证券股份有限公司平阳人民路证券营业部   | 平阳县昆阳镇京都花苑 A 幢 105 房                 | 0577-23669777 |
| 55 | 方正证券股份有限公司苍南站前大道证券营业部  | 苍南县灵溪镇站前大道怡和城市家园 3-6 幢商铺 102 室       | 0577-68873771 |
| 56 | 方正证券股份有限公司义乌北门街证券营业部   | 浙江省义乌北门街 290 号 2 楼                   | 0579-85530801 |
| 57 | 方正证券股份有限公司磐安壶厅东路证券营业部  | 磐安县安文镇壶厅东路 7 号                       | 0579-84660777 |

|    |     |                         |  |                    |
|----|-----|-------------------------|--|--------------------|
| 58 |     | 方正证券股份有限公司绍兴胜利东路证券营业部   | 浙江省绍兴市胜利东路 39 号中兴商贸大厦三楼                              | 0575-85222008      |
| 59 |     | 方正证券股份有限公司新昌人民中路证券营业部   | 新昌县南明街道人民中路 283 号                                    | 0575-86621971      |
| 60 |     | 方正证券股份有限公司诸暨东二路证券营业部    | 诸暨市暨阳街道东二路 47 号                                      | 0575-88698500      |
| 61 |     | 方正证券股份有限公司嘉兴中环西路证券营业部   | 嘉兴市中环西路 1228 号-2、中环西路 1238 号隆禧大厦商铺 201 室、2105-2107 室 | 0573-82988888      |
| 62 |     | 方正证券股份有限公司桐乡市场路证券营业部    | 桐乡市梧桐街道振东新区市场路 401、403 号                             | 0573-88139188      |
| 63 |     | 方正证券股份有限公司兰溪兰荫路证券营业部    | 浙江省兰溪市兰江街道兰荫路 99 号                                   | 0579-88824111      |
| 64 |     | 方正证券股份有限公司东阳吴宁东路证券营业部   | 浙江省东阳市吴宁东路 9 号二楼                                     | 0579-86198388      |
| 65 |     | 方正证券股份有限公司宁波解放北路证券营业部   | 宁波市海曙区解放北路 128 号新金穗大厦 8 楼                            | 0574-87176571      |
| 66 |     | 方正证券股份有限公司宁波长寿南路证券营业部   | 宁波市鄞州区中河街道长寿南路 555 号 205 室                           | 0574-87176562      |
| 67 |     | 方正证券股份有限公司宁波文昌街证券营业部    | 宁波市海曙区文昌街 2 号 B 楼一层                                  | 0574-83071781      |
| 68 |     | 方正证券股份有限公司舟山环城西路证券营业部   | 舟山市定海区环城西路 21 号                                      | 0580-2111558       |
| 69 |     | 方正证券股份有限公司慈溪人和路证券营业部    | 慈溪市白沙路街道人和路 515 号浪木大厦 3-3-07、3-3-08 室                | 0574-63009698      |
| 70 |     | 方正证券股份有限公司长沙留芳岭证券营业部    | 长沙市开福区留芳岭 2 号  | 0731-84206399      |
| 71 |     | 方正证券股份有限公司长沙金泰路证券营业部    | 长沙市开福区金泰路 199 号湘江世纪城达江苑市政道路层-11159 号门面 1 楼           | 0731-82562257      |
| 72 |     | 方正证券股份有限公司长沙黄兴中路证券营业部   | 长沙市黄兴中路 196 号新大新大厦五层                                 | 0731-8293-489<br>3 |
| 73 |     | 方正证券股份有限公司长沙芙蓉中路证券营业部   | 长沙市天心区芙蓉中路二段 200 号体育公寓 4 栋 25 楼                      | 0731-82829798      |
| 74 |     | 方正证券股份有限公司长沙芙蓉路证券营业部    | 湖南省长沙市天心区芙蓉中路 450 号恒生大厦四层                            | 0731-88398619      |
| 75 |     | 方正证券股份有限公司长沙五一东路证券营业部   | 长沙市芙蓉区五一大道 100 号                                     | 0731-82299908      |
| 76 |     | 方正证券股份有限公司长沙建湘路证券营业部    | 长沙市芙蓉区建湘路 479 号 202、302 房                            | 0731-85187137      |
| 77 |     | 方正证券股份有限公司长沙桐梓坡路证券营业部   | 长沙市岳麓区桐梓坡路 485 号沁园春御苑 8 号楼裙楼贰楼西侧                     | 0731-85393288      |
| 78 | 湖南省 | 方正证券股份有限公司长沙韶山南路证券营业部   | 长沙市雨花区韶山南路 777 号（红星井湾子家居广场 C 座 4 楼）                  | 0731-85393399      |
| 79 |     | 方正证券股份有限公司长沙枫林三路证券营业部   | 长沙市岳麓区枫林三路 238 号梅西湖畔华苑 1 栋 201 房                     | 0731-88789501      |
| 80 |     | 方正证券股份有限公司长沙宁乡沿河北路证券营业部 | 宁乡县玉潭镇沿河北路 118 号 7 栋临街商铺 2 楼                         | 0731-87819698      |
| 81 |     | 方正证券股份有限公司长沙望城宝粮路证券营业部  | 长沙市望城区宝粮西路 128 号                                     | 0731-84072395      |
| 82 |     | 方正证券股份有限公司长沙星沙三一路证券营业部  | 长沙星沙镇三一路 93 号 3 楼                                    | 0731-84072035      |
| 83 |     | 方正证券股份有限公司浏阳金沙路证券营业部    | 湖南省浏阳市圭斋路与金沙中路交叉处中央公园 A 栋 4 楼                        | 0731-83637003      |
| 84 |     | 方正证券股份有限公司株洲新华西路证券营业部   | 湖南省株洲市芦淞区新华西路 999 号中央商业广场 2502-2513 号                | 0731-28108033      |
| 85 |     | 方正证券股份有限公司株洲芦淞路证券营业部    | 株洲市芦淞区芦淞路 1127 号                                     | 0731-22210976      |
| 86 |     | 方正证券股份有限公司株洲田红路证券营业部    | 株洲市石峰区（田心）田红路 110 号泉塘湾二期项目 9 栋 2 层 204、205 号门面       | 0731-22523257      |

|     |                                  |   |               |
|-----|----------------------------------|---|---------------|
| 87  | 方正证券股份有限公司株洲新华路证券营业部             | 株洲市新华西路 469 号市政大厦 2 层                         | 0731-22160901 |
| 88  | 方正证券股份有限公司株洲渌口镇向阳南路证券营业部         | 株洲县渌口镇向阳南路 54 号(县人社局办公楼一楼)                    | 0731-27282228 |
| 89  | 方正证券股份有限公司醴陵胜利路证券营业部             | 湖南省醴陵市胜利路 148 号供销大厦三楼                         | 0731-23215108 |
| 90  | 方正证券股份有限公司株洲攸县大巷路证券营业部           | 攸县联星街道雪花社区大巷路 46 号                            | 0731-24321658 |
| 91  | 方正证券股份有限公司株洲茶陵朝阳街证券营业部           | 茶陵县城关镇朝阳街朝阳新城 2 栋 103-104 门面 1-2 层            | 0731-22103688 |
| 92  | 方正证券股份有限公司湘潭韶山中路证券营业部            | 湘潭市雨湖区韶山中路 28 号安国大厦四楼                         | 0731-52826528 |
| 93  | 方正证券股份有限公司湘潭县凤凰中路证券营业部           | 湘潭县易俗河镇凤凰中路莲乡公寓右侧 1-2 楼                       | 0731-57336337 |
| 94  | 方正证券股份有限公司韶山迎宾路证券营业部             | 韶山市清溪镇迎宾路 21 号                                | 0731-55685799 |
| 95  | 方正证券股份有限公司湘潭建设路证券营业部             | 湖南省湘潭市岳塘区建设路莲城步步高超市 4 楼                       | 0731-58528913 |
| 96  | 方正证券股份有限公司湘乡桑梅路证券营业部             | 湖南省湘乡市新湘路办事处工贸新区桑梅中路鼎龙大厦侧 02 栋 2 层            | 0731-52435288 |
| 97  | 方正证券股份有限公司湘潭板塘证券营业部              | 湘潭市岳塘区社建村街道东信花园融城苑 4 栋                        | 0731-52815608 |
| 98  | 方正证券股份有限公司常德武陵大道证券营业部            | 湖南省常德市武陵区城西办事处长胜桥居委会武陵大道中段 377 号(紫云天商居大厦 4 楼) | 0736-7250008  |
| 99  | 方正证券股份有限公司常德石门宝峰路证券营业部           | 湖南省常德市石门县楚江镇中渡居委会宝峰路(中国银行石门支行办公楼三楼)           | 0736-7239692  |
| 100 | 方正证券股份有限公司常德鼎城路证券营业部             | 常德市鼎城区武陵镇德安社区鼎城路(枫丹丽舍 1 栋 8 号一楼)              | 0736-7225488  |
| 101 | 方正证券股份有限公司常德汉寿龙阳中路证券营业部          | 湖南省汉寿县龙阳镇新街社区龙阳中路 405 号                       | 0736-2858869  |
| 102 | 方正证券股份有限公司常德临澧朝阳东街证券营业部          | 湖南省临澧县安福镇朝阳街社区居委会朝阳东街 88 号                    | 0736-5833508  |
| 103 | 方正证券股份有限公司张家界慈利古城路证券营业部          | 慈利县零阳镇古城路 08 号                                | 0744-3225571  |
| 104 | 方正证券股份有限公司常德津市澧津路证券营业部           | 常德市津市市三洲驿办事处桥北社区澧津路 17 号(津市中国银行营业厅)           | 0736-4206686  |
| 105 | 方正证券股份有限公司常德澧县澧浦路证券营业部           | 澧县澧阳镇澧阳居委会澧浦路锦绣玫瑰园 25 栋 111-112 号             | 0736-3319188  |
| 106 | 方正证券股份有限公司常德安乡县深柳镇长岭洲社区昌颐路 102 号 | 湖南省安乡县深柳镇长岭洲社区昌颐路 102 号                       | 0736-4722199  |
| 107 | 方正证券股份有限公司益阳长益路证券营业部             | 益阳市桃花仑西路 755 号                                | 0737-4220444  |
| 108 | 方正证券股份有限公司益阳五一路证券营业部             | 益阳市资阳区五一路北大门购物广场 4 楼 C 区                      | 0737-4328926  |
| 109 | 方正证券股份有限公司益阳南县兴盛大道证券营业部          | 南县南洲镇火箭小区西头 6 栋 1 层                           | 0737-5239929  |
| 110 | 方正证券股份有限公司益阳安化新开路证券营业部           | 湖南省安化县东坪镇新开路水土保持局临街门面                         | 0737-7223810  |
| 111 | 方正证券股份有限公司益阳桃江獭溪路证券营业部           | 湖南省益阳市桃江县桃花江镇獭溪路 238 号                        | 0737-8995571  |
| 112 | 方正证券股份有限公司岳阳东茅岭证券营业部             | 湖南省岳阳市岳阳楼区东茅岭步行街东方明珠大厦 8 楼                    | 0730-8321066  |
| 113 | 方正证券股份有限公司临湘河西南路证券营业部            | 湖南省临湘市星河广场商业街七号                               | 0730-2941116  |
| 114 | 方正证券股份有限公司汨罗高泉南路证券营业部            | 湖南省汨罗市高泉南路 16 号三楼                             | 0730-2930677  |
| 115 | 方正证券股份有限公司岳阳巴陵东路证券营业部            | 岳阳市岳阳楼区巴陵东路 112 号富兴大厦 2 楼                     | 0730-8819918  |

|     |                         |   |              |
|-----|-------------------------|---|--------------|
| 116 | 方正证券股份有限公司岳阳华容迎宾北路证券营业部 | 华容县迎宾北路华容广场 125 号                               | 0730-8819896 |
| 117 | 方正证券股份有限公司怀化芷江路证券营业部    | 怀化市鹤城区芷江路(西都银座五楼)                               | 0745-2767188 |
| 118 | 方正证券股份有限公司怀化溆浦警予东路证券营业部 | 湖南省怀化市溆浦县警予东路 61 号<br>邮政大楼 3 楼                  | 0745-2221293 |
| 119 | 方正证券股份有限公司洪江开元大道证券营业部   | 湖南省洪江市黔城镇开元大道东大豪<br>居 1 幢 1 层 102-103 铺         | 0745-7737878 |
| 120 | 方正证券股份有限公司怀化麻阳五一东路证券营业部 | 湖南省麻阳苗族自治县高村镇五一东<br>路 205 号                     | 0745-5829677 |
| 121 | 方正证券股份有限公司怀化沅陵迎宾南路证券营业部 | 沅陵县沅陵镇迎宾南路 22 号(安监局<br>旁)                       | 0745-4771418 |
| 122 | 方正证券股份有限公司怀化迎丰路证券营业部    | 湖南省怀化市迎丰路 206 号                                 | 0745-2250059 |
| 123 | 方正证券股份有限公司怀化靖州渠阳中路证券营业部 | 湖南省怀化靖州县渠阳中路 6 号综合<br>楼 2 楼                     | 0745-8230180 |
| 124 | 方正证券股份有限公司怀化新晃通达路证券营业部  | 新晃县通达路梅林春天 37 幢 101 铺面                          | 0745-6226515 |
| 125 | 方正证券股份有限公司怀化会同拥军路证券营业部  | 会同县林城镇拥军路 168 号                                 | 0745-8821928 |
| 126 | 方正证券股份有限公司邵阳邵水西路证券营业部   | 邵阳市大祥区邵水西路 155 号                                | 0739-5363268 |
| 127 | 方正证券股份有限公司邵阳县凤凰街证券营业部   | 邵阳县塘渡口镇凤凰街 241 号                                | 0739-8935155 |
| 128 | 方正证券股份有限公司邵阳新邵酿溪大道证券营业部 | 新邵县酿溪镇城市花园小区第 11 栋 1<br>层 107 铺第 11 栋 2 层 207 铺 | 0739-8950089 |
| 129 | 方正证券股份有限公司邵阳城步城南南路证券营业部 | 城步儒林镇城南南路 40 号                                  | 15675940189  |
| 130 | 方正证券股份有限公司武冈武冈大道证券营业部   | 武冈市迎春亭办事处武冈大道(中)<br>二巷前栋                        | 0739-5361889 |
| 131 | 方正证券股份有限公司邵阳洞口桔城路证券营业部  | 洞口县洞口镇桔城路 220 号新华书店<br>三楼                       | 0739-7277908 |
| 132 | 方正证券股份有限公司邵阳隆回桃花路证券营业部  | 湖南省邵阳市隆回县桃洪镇桃花路<br>277 号(张家垅开发区)                | 0739-8588088 |
| 133 | 方正证券股份有限公司邵阳邵东红岭路证券营业部  | 湖南省邵阳邵东红岭路中天大厦 2 楼                              | 0739-2727149 |
| 134 | 方正证券股份有限公司邵东廉桥南昌路证券营业部  | 湖南省邵东县廉桥镇南国药都南昌路<br>121 号                       | 0739-2956622 |
| 135 | 方正证券股份有限公司娄底南贸西街证券营业部   | 娄底市娄星区南贸西街 3 号                                  | 0738-8515733 |
| 136 | 方正证券股份有限公司娄底涟源交通路证券营业部  | 湖南省娄底涟源交通路三角坪商业广<br>场三楼                         | 0738-4451006 |
| 137 | 方正证券股份有限公司娄底双峰复兴路证券营业部  | 湖南省娄底市双峰县复兴路 487 号 2<br>层                       | 0738-8955998 |
| 138 | 方正证券股份有限公司冷水江锑都中路证券营业部  | 湖南省冷水江市锑都中路 36 号商业<br>步行街 B 区 4 楼               | 0738-8995557 |
| 139 | 方正证券股份有限公司娄底新化梅苑南路证券营业部 | 湖南省新化县梅苑开发区梅苑南路 B<br>栋 107、108 号                | 0738-3261803 |
| 140 | 方正证券股份有限公司衡阳船山大道证券营业部   | 衡阳市石鼓区船山路 30 号长和广场<br>三层                        | 0734-8172060 |
| 141 | 方正证券股份有限公司衡阳衡东洙江大道证券营业部 | 衡东县城关镇洙江大道 468 号                                | 0734-5210737 |
| 142 | 方正证券股份有限公司衡阳解放大道证券营业部   | 湖南省衡阳市高新区解放大道 6 号众<br>鑫大厦 109 号门面               | 0734-8855056 |
| 143 | 方正证券股份有限公司衡阳衡山人民西路证券营业部 | 湖南省衡山县开云镇人民西路 70 号                              | 0734-5826580 |
| 144 | 方正证券股份有限公司衡阳东风北路证券营业部   | 衡阳市珠晖区东风北路安全里 27-87<br>号东方名居 B 栋 201 室          | 0734-3459355 |
| 145 | 方正证券股份有限公司耒阳金桥路证券营业部    | 耒阳市蔡子池街道办事处金桥路<br>138-140 号                     | 0734-4996606 |

|     |                         |                                  |               |
|-----|-------------------------|----------------------------------|---------------|
| 146 | 方正证券股份有限公司衡阳祁东民生街证券营业部  | 湖南省衡阳市祁东县民生街1号1-5楼               | 0734-6299610  |
| 147 | 方正证券股份有限公司常宁群英西路证券营业部   | 湖南省常宁市群英西路79-80号                 | 0734-7677365  |
| 148 | 方正证券股份有限公司衡阳县蒸阳大道证券营业部  | 衡阳县西渡镇蒸阳大道246-12号                | 0734-6819365  |
| 149 | 方正证券股份有限公司郴州文化路证券营业部    | 郴州市北湖区文化路11号铂金时代三楼301室           | 0735-2258999  |
| 150 | 方正证券股份有限公司郴州嘉禾人民路证券营业部  | 嘉禾县珠泉镇人民北路1号                     | 0735-8196588  |
| 151 | 方正证券股份有限公司郴州青年大道证券营业部   | 郴州市北湖区青年大道湘南风情康居园18栋1楼1010号      | 0735-2241902  |
| 152 | 方正证券股份有限公司郴州安仁五一中路证券营业部 | 湖南省郴州市安仁县永乐江镇五一中路425号            | 0735-8199889  |
| 153 | 方正证券股份有限公司郴州永兴干劲路证券营业部  | 永兴县便江镇干劲路35号(中国银行永兴支行4-6楼)       | 0735-5530789  |
| 154 | 方正证券股份有限公司郴州桂阳芙蓉西路证券营业部 | 桂阳县鹿峰街道芙蓉西路18号后勤保障综合大楼3楼         | 0735-4468195  |
| 155 | 方正证券股份有限公司郴州宜章宜兴路证券营业部  | 宜章县南京洞宜兴路君泰大酒店三楼                 | 0735-3728788  |
| 156 | 方正证券股份有限公司郴州临武临武大道证券营业部 | 湖南省临武县武水镇临武大道县水务局门面              | 0735-8195571  |
| 157 | 方正证券股份有限公司资兴东江中路证券营业部   | 资兴市东江中路建行二楼                      | 0735-3329899  |
| 158 | 方正证券股份有限公司郴州桂东东华路证券营业部  | 桂东县东华路桂东县总工会二楼                   | 0735-8830055  |
| 159 | 方正证券股份有限公司永州清桥路证券营业部    | 湖南省永州市冷水滩区清桥路13号                 | 0746-8336366  |
| 160 | 方正证券股份有限公司永州祁阳金盆西路证券营业部 | 湖南省祁阳县长虹街道办事处金盆西路朱锡全私房一至二楼       | 0746-3238086  |
| 161 | 方正证券股份有限公司永州东安八角街证券营业部  | 湖南省东安县白牙市镇八角街18号                 | 0746-4699275  |
| 162 | 方正证券股份有限公司永州南津中路证券营业部   | 湖南省永州市零陵区南津中路四号五星广场三楼            | 0746-6323658  |
| 163 | 方正证券股份有限公司永州道县红星东路证券营业部 | 湖南省道县道江镇红星东路98号                  | 0746-5217527  |
| 164 | 方正证券股份有限公司永州蓝山湘粤路证券营业部  | 湖南省永州市蓝山县塔峰镇湘粤路202号              | 0746-2225799  |
| 165 | 方正证券股份有限公司永州江华萌渚路证券营业部  | 湖南省永州市江华瑶族自治县沱江镇萌渚路金三角A栋10号      | 0746-2626326  |
| 166 | 方正证券股份有限公司永州宁远泠江东路证券营业部 | 宁远县舜陵镇泠江东路56号                    | 0746-7223335  |
| 167 | 方正证券股份有限公司吉首人民北路证券营业部   | 湖南省吉首市人民北路77号(原金三角)              | 0743-8711796  |
| 168 | 方正证券股份有限公司郑州嵩山南路证券营业部   | 郑州市二七区嵩山南路81号机械研究所单身职工公寓         | 0371-67723518 |
| 169 | 方正证券股份有限公司南阳人民路证券营业部    | 南阳市宛城区人民北路319号                   | 0377-63222199 |
| 170 | 方正证券股份有限公司郑州瑞达路证券营业部    | 郑州高新区瑞达路68号1号楼                   | 0371-67996567 |
| 171 | 方正证券股份有限公司郑州未来路证券营业部    | 郑州市管城区未来路855号3号楼25号              | 0371-55637869 |
| 172 | 方正证券股份有限公司濮阳黄河路证券营业部    | 濮阳市黄河路与扶余路交叉口西20米路北              | 0393-6167017  |
| 173 | 方正证券股份有限公司三门峡黄河中路证券营业部  | 三门峡市湖滨区黄河中路4号怡居酒店七层(宇龙纺织器材公司办公楼) | 0398-2166779  |
| 174 | 方正证券股份有限公司郑州渠东路证券营业部    | 郑州市金水区渠东路6号院圣菲城滨水大厦商铺2层附1号       | 0371-60332608 |
| 175 | 方正证券股份有限公司郑州陇海路证券营业部    | 郑州市管城回族区陇海东路66号1号楼2层15号          | 0371-60332896 |

|     |     |                        |  |               |
|-----|-----|------------------------|--|---------------|
| 176 |     | 方正证券股份有限公司郑州天明路证券营业部   | 郑州市金水区天明路 72 号院 2 号楼 5 号商铺                           | 0371-60332237 |
| 177 |     | 方正证券股份有限公司信阳申碑路证券营业部   | 信阳市浉河区申碑路金杯花园 18 号楼 1、2 层                            | 0376-6500560  |
| 178 |     | 方正证券股份有限公司周口中州路证券营业部   | 周口市川汇区中州路与人民路交叉口农行二楼                                 | 0394 3751977  |
| 179 |     | 方正证券股份有限公司商丘神火大道证券营业部  | 商丘市梁园区神火大道株洲路北（一中家属院楼 4 号楼 1 层北数第 8 间门面）             | 0370-2781702  |
| 180 |     | 方正证券股份有限公司洛阳中州中路证券营业部  | 洛阳市西工区中州中路 445 号 1 幢 606、609 室                       | 0379-80885102 |
| 181 |     | 方正证券股份有限公司开封晋安路证券营业部   | 开封市济南路荣勋花园 5 号                                       | 0371-25553468 |
| 182 |     | 方正证券股份有限公司平顶山建设路证券营业部  | 平顶山市卫东区建设路 57 号广厦大厦 1、2、3 楼                          | 0375-2369807  |
| 183 |     | 方正证券股份有限公司漯河滨河路证券营业部   | 漯河市源汇区滨河路与交通路交叉口昌建外滩 18#18 幢 108 号                   | 0395-3366618  |
| 184 |     | 方正证券股份有限公司许昌南关大街证券营业部  | 许昌市魏都区南关大街（七一路 83 号月满楼宾馆二楼）                          | 0374-7385518  |
| 185 |     | 方正证券股份有限公司驻马店置地大道证券营业部 | 驻马店市天中山大道与置地大道交叉口白金名邸（浩昌环境大楼一楼西侧）                    | 0396:2709088  |
| 186 |     | 方正证券股份有限公司新乡平原路证券营业部   | 新乡市红旗区平原路 289 号交通银行第三层                               | 0373 2031606  |
| 187 |     | 方正证券股份有限公司安阳文峰大道证券营业部  | 安阳市殷都区文峰大道城际双座 A 栋 102                               | 0372-5379636  |
| 188 |     | 方正证券股份有限公司焦作长恩路证券营业部   | 焦作市山阳区长恩路 1506 号                                     | 0391-3881369  |
| 189 |     | 方正证券股份有限公司鹤壁兴鹤大街证券营业部  | 鹤壁市淇滨区兴鹤大街 218 号 1 楼玻璃房                              | 0392-3886808  |
| 190 |     | 方正证券股份有限公司济源宣化东街证券营业部  | 济源市济水办事处宣化东街 129 号                                   | 0391-6272221  |
| 191 | 贵州省 | 方正证券股份有限公司贵阳中华中路证券营业部  | 贵州省贵阳市云岩区中华中路 168-170 号贵阳饭店八楼                        | 0851-86901694 |
| 192 |     | 方正证券股份有限公司六盘水青峰路证券营业部  | 贵州省六盘水市钟山区青峰路 3 号附 17 号（凤凰）                          | 0858-8169187  |
| 193 |     | 方正证券股份有限公司都匀云鹤路证券营业部   | 都匀市云鹤路 91 号  | 0854-7080886  |
| 194 |     | 方正证券股份有限公司贵阳长岭北路证券营业部  | 贵州省贵阳市观山湖区长岭北路 1 号贵阳国际展览中心二号馆二、三层贵阳互联网金融产业园 309-74 室 | 0851-88500577 |
| 195 | 河北省 | 方正证券股份有限公司保定朝阳北大街证券营业部 | 保定市朝阳北大街 507 号                                       | 0312-3091030  |
| 196 |     | 方正证券股份有限公司沧州西环中街证券营业部  | 河北省沧州市运河区西环中街 76 号 3 号门市                             | 0317-5207800  |
| 197 |     | 方正证券股份有限公司唐山兴源道证券营业部   | 唐山路北区兴源道 71 号  | 0315-2357116  |
| 198 |     | 方正证券股份有限公司三河燕郊汉王路证券营业部 | 河北省廊坊市三河市燕郊开发区行宫东大街南侧汉王路西侧中盛世纪 10 商业楼 1012 号         | 0316-3093866  |
| 199 | 山西省 | 方正证券股份有限公司太原新建南路证券营业部  | 太原市新建南路 115 号工会大厦四层、五层                               | 0351-4690988  |
| 200 |     | 方正证券股份有限公司临汾鼓楼南大街证券营业部 | 临汾市尧都区鼓楼南大街 41 号                                     | 0357-7181900  |
| 201 |     | 方正证券股份有限公司吕梁龙凤北大街证券营业部 | 吕梁市离石区龙凤北大街 109 号                                    | 0358-2274988  |
| 202 | 广西省 | 方正证券股份有限公司南宁衡阳西路证券营业部  | 广西南宁市西乡塘区衡阳西路 17 号临街 1 号楼一楼 4 号铺面及二楼                 | 0771-3395236  |
| 203 |     | 方正证券股份有限公司河池新建路证券营业部   | 广西河池市新建路 83 号  | 0778-8178881  |

|     |                        |                          |                                       |                           |
|-----|------------------------|--------------------------|---------------------------------------|---------------------------|
| 204 |                        | 方正证券股份有限公司桂林自由路证券营业部     | 桂林市七星区自由路6号综合楼1-3号铺面                  | 0773-5823588              |
| 205 |                        | 方正证券股份有限公司玉林广电路证券营业部     | 玉林市玉州区广电路1号玉林广播电视报社大楼一楼、四楼            | 0775-2677889              |
| 206 | 山东省                    | 方正证券股份有限公司青岛江西路证券营业部     | 山东省青岛市市南区江西路106号3户                    | 0532-68895730             |
| 207 |                        | 方正证券股份有限公司青岛胶州苏州路证券营业部   | 山东省青岛市胶州市苏州路157号蓓蕾大厦楼内                | 0532-86629589             |
| 208 |                        | 方正证券股份有限公司诸城密州东路证券营业部    | 山东省潍坊市诸城市密州东路28号富泰花园1号                | 0536-2161138              |
| 209 |                        | 方正证券股份有限公司济南顺河东街证券营业部    | 济南市市中区顺河东街66号银座晶都国际广场1号楼232室          | 0531-66687818             |
| 210 |                        | 方正证券股份有限公司济南经一路证券营业部     | 山东省济南市槐荫区经一路273号群盛华城3号楼2-105号         | 0531-80992008             |
| 211 |                        | 方正证券股份有限公司济南文化东路证券营业部    | 山东省济南市历下区文化东路普利文东花园1-2-401            | 0531-81185197             |
| 212 |                        | 江苏省                      | 方正证券股份有限公司南京珠江路证券营业部                  | 南京市玄武区珠江路699号东鼎大厦1号楼1层、4层 |
| 213 | 方正证券股份有限公司常州延陵西路证券营业部  |                          | 常州市延陵西路99号703室(嘉业国贸广场)                | 0519-85260871             |
| 214 | 方正证券股份有限公司南京溧水中山路证券营业部 |                          | 南京溧水区永阳镇中山路28号6室                      | 025-56223560              |
| 215 | 方正证券股份有限公司南京文澜路证券营业部   |                          | 南京市栖霞区仙林街道文澜路6号中建大厦二楼203室             | 025-86586759              |
| 216 | 方正证券股份有限公司扬州文昌西路证券营业部  |                          | 扬州市邗江区金都汇大厦1幢8楼                       | 0514-82991075             |
| 217 | 江西省                    | 方正证券股份有限公司南昌南京西路证券营业部    | 江西省南昌市南京西路219号                        | 0791-86362081             |
| 218 |                        | 方正证券股份有限公司南昌菊圃路证券营业部     | 江西省南昌经济技术开发区菊圃路99号学府馨苑商住小区2号楼101室     | 0791-83801765             |
| 219 |                        | 方正证券股份有限公司吉安吉州大道证券营业部    | 吉安市吉州大道11号1幢9、10号门面                   | 0796-8938698              |
| 220 |                        | 方正证券股份有限公司上饶庆丰路证券营业部     | 江西省上饶市信州区明珠商业广场17幢3层12号               | 0793-8207582              |
| 221 |                        | 方正证券股份有限公司宜春东风大街证券营业部    | 江西省宜春市东风大街44号                         | 0795-3196616              |
| 222 | 福建省                    | 方正证券股份有限公司厦门厦禾路证券营业部     | 厦门市思明区厦禾路873号之三十四312单元                | 0592-5831081              |
| 223 |                        | 方正证券股份有限公司泉州泉秀路证券营业部     | 福建省泉州市丰泽区云鹿路与泉州路交叉口泉州东海液压润滑设备厂A栋五层501 | 0595-28670077             |
| 224 |                        | 方正证券股份有限公司福州湖东路证券营业部     | 福建省福州市鼓楼区湖东路168号宏利大厦写字楼21层C区          | 0591-88388213             |
| 225 | 云南省                    | 方正证券股份有限公司昆明三市街证券营业部     | 云南省昆明市三市街6号                           | 0871-63601012             |
| 226 |                        | 方正证券股份有限公司玉溪龙马路证券营业部     | 云南省玉溪市红塔区龙马路30号                       | 0877-2795571              |
| 227 |                        | 方正证券股份有限公司昆明禄劝掌鸠河北路证券营业部 | 云南省昆明市禄劝彝族苗族自治县掌鸠河北路                  | 0871-68965571             |
| 228 | 陕西省                    | 方正证券股份有限公司西安南大街证券营业部     | 西安市南大街粉巷3号王子大厦9楼内                     | 029-68661929              |
| 229 |                        | 方正证券股份有限公司安康巴山路证券营业部     | 陕西省安康市汉滨区巴山西路132号(康兴园2号楼西侧)           | 0915-8880801              |
| 230 | 湖北省                    | 方正证券股份有限公司武汉中南二路证券营业部    | 湖北省武汉市武昌区中南二路16号1、3楼                  | 027-87201918              |
| 231 |                        | 方正证券股份有限公司武汉新华路证券营业部     | 武汉市江汉区新华街296号江汉国际1栋1单元11层10室          | 027-85571316              |
| 232 |                        | 方正证券股份有限公司武汉光谷大道证券营业部    | 武汉市东湖新技术开发区光谷大道22号方顺恒瑞广场12楼1203、1204  | 027-87788926              |

|     |     |                        | 室   |               |
|-----|-----|------------------------|---|---------------|
| 233 |     | 方正证券股份有限公司襄阳檀溪路证券营业部   | 襄阳市襄城区檀溪路山水檀溪 B 区山园 1 幢 1-2 层 108、207 室                         | 0710-3566605  |
| 234 | 安徽省 | 方正证券股份有限公司合肥黄山路证券营业部   | 安徽省合肥市蜀山区黄山路西环商贸中心 11 栋北楼 111 商铺 1-2 层                          | 0551-65770268 |
| 235 |     | 方正证券股份有限公司马鞍山佳山路证券营业部  | 马鞍山市花山区佳山路 24 号一层   | 0555-2825777  |
| 236 | 四川省 | 方正证券股份有限公司成都高升桥路证券营业部  | 成都市武侯区高升桥路 9 号 5 栋 6 层 608、609 号                                | 028-87051565  |
| 237 |     | 方正证券股份有限公司成都人民中路证券营业部  | 成都市青羊区人民中路二段 29 号 1 栋 25 层 2507 房                               | 028-86658351  |
| 238 | 天津市 | 方正证券股份有限公司天津新华路证券营业部   | 天津市和平区新华路 166 号   | 022-23141867  |
| 239 |     | 方正证券股份有限公司天津解放南路证券营业部  | 天津市河西区解放南路与湘江道交口铂津湾南苑配建 14-铂津湾南苑 26 号底商                         | 022-28272367  |
| 240 |     | 方正证券股份有限公司天津复康路证券营业部   | 天津市南开区复康路 105 号   | 022-23141868  |
| 241 |     | 方正证券股份有限公司天津密云路证券营业部   | 天津市南开区密云路与黄河道交口西南侧北方城一区 36-108 (新五金城 1 期 36 栋 108 号) 房屋 1 层、2 层 | 022-23141866  |
| 242 | 重庆市 | 方正证券股份有限公司重庆新南路证券营业部   | 重庆市渝北区新南路 9 号碧海金都 1 幢 2 层                                       | 023-88505266  |
| 243 |     | 方正证券股份有限公司重庆杨家坪正街证券营业部 | 重庆市九龙坡区杨家坪正街 8 号 3 幢第二层 8、9 号门面                                 | 023-68648982  |
| 244 | 甘肃省 | 方正证券股份有限公司兰州金昌南路证券营业部  | 甘肃省兰州市城关区金昌南路 148 号泉景大厦二楼                                       | 0931-8439285  |

### 证券营业部（民族证券）

| 序号 | 区域                      | 营业部名称                      | 地址                                  | 联系电话                                    |               |
|----|-------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---|---------------|
| 1  | 广东省                     | 中国民族证券有限责任公司深圳深南大道证券营业部    | 深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋24A          | 0755-83795558                           |               |
| 2  |                         | 中国民族证券有限责任公司广州环市东路证券营业部    | 广州市越秀区环市东路334号市政中环大厦10层01、02、08、09房 | 020-37653909                            |               |
| 3  |                         | 中国民族证券有限责任公司江门港口路证券营业部     | 江门市港口路22号国际金融中心12层                  | 0750-3061166                            |               |
| 5  | 黑龙江省                    | 中国民族证券有限责任公司哈尔滨赣水路证券营业部    | 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路28号二、三层               | 0451-53678827                           |               |
| 6  |                         | 中国民族证券有限责任公司哈尔滨阿城牌路大街证券营业部 | 哈尔滨市阿城牌路大街59号(阿城宾馆三层)               | 0451-53808555                           |               |
| 7  | 辽宁省                     | 中国民族证券有限责任公司沈阳热闹路证券营业部     | 沈阳市沈河区热闹路30号国峰大厦1层、6层               | 024-24856666                            |               |
| 8  |                         | 中国民族证券有限责任公司沈阳中华路证券营业部     | 沈阳市和平区中华路57号金杯大厦后院                  | 024-23857777                            |               |
| 9  |                         | 中国民族证券有限责任公司大连五四路证券营业部     | 大连市西岗区五四路30号                        | 0411-83699992                           |               |
| 10 |                         | 中国民族证券有限责任公司鞍山人民路证券营业部     | 鞍山市铁西区人民路49号                        | 0412-8529888                            |               |
| 11 |                         | 中国民族证券有限责任公司鞍山胜利北路证券营业部    | 鞍山市立山区胜利北路14号                       | 0412-6380008                            |               |
| 12 |                         | 中国民族证券有限责任公司鞍山胜利南路证券营业部    | 鞍山市铁东区胜利南路8甲2号                      | 0412-2245411                            |               |
| 13 |                         | 中国民族证券有限责任公司鞍山二道街证券营业部     | 鞍山市铁东区二道街78号                        | 0412-2219718                            |               |
| 14 |                         | 中国民族证券有限责任公司鞍山湖南街证券营业部     | 鞍山市铁东区湖南街24号                        | 0412-5814000                            |               |
| 15 |                         | 中国民族证券有限责任公司海城北顺城路证券营业部    | 海城市海洲管理区北关街灯塔委北顺城路30栋8号             | 0412-3243999                            |               |
| 15 |                         | 江苏省                        | 中国民族证券有限责任公司南京西康路证券营业部              | 南京市鼓楼区西康路7号3楼                           | 025-83752003  |
| 16 |                         |                            | 中国民族证券有限责任公司苏州玉山路证券营业部              | 苏州市高新区玉山路99号2幢钻石广场四层408、409室            | 0512-88180891 |
| 17 |                         | 北京市                        | 中国民族证券有限责任公司北京望京证券营业部               | 北京市朝阳区望京街9号商业楼三层325-1、325-2、326-1、326-2 | 010-64280224  |
| 18 |                         |                            | 中国民族证券有限责任公司北京佟麟阁路证券营业部             | 北京市西城区佟麟阁路95号尚信大厦6-7层                   | 010-66413223  |
| 19 |                         |                            | 中国民族证券有限责任公司北京彩和坊路证券营业部             | 北京市海淀区彩和坊路8号1层101、102室                  | 010-62698099  |
| 20 |                         |                            | 中国民族证券有限责任公司北京丰台西局欣园证券营业部           | 北京市丰台区西局欣园南区3号楼                         | 010-63856400  |
| 21 | 中国民族证券有限责任公司北京安慧东里证券营业部 |                            | 北京市朝阳区安慧东里36号4号楼8号                  | 010-68188769                            |               |
| 22 | 上海市                     | 中国民族证券有限责任公司上海延平路证券营业部     | 上海市静安区延平路71号                        | 021-62329746                            |               |
| 23 |                         | 中国民族证券有限责任公司上海浦明路证券营业部     | 上海市浦东新区浦明路898号7楼B单元                 | 021-58600528                            |               |
| 24 |                         | 中国民族证券有限责任公司上海南丹东路证券营业部    | 上海市南丹东路300弄9号904-910室               | 021-51197111                            |               |
| 25 | 福建省                     | 中国民族证券有限责任公司漳州新华北路证券营业部    | 福建省漳州市芗城区新华北路54号A1幢二层3-8号           | 0596-2671800                            |               |

|    |      |                           |                                       |                |
|----|------|---------------------------|---------------------------------------|----------------|
| 26 | 浙江省  | 中国民族证券有限责任公司杭州朝晖路证券营业部    | 浙江省杭州市下城区朝晖路 221 号的中山花园秋月楼 2 楼        | 0571-85388968  |
| 27 |      | 中国民族证券有限责任公司宁波中山西路证券营业部   | 宁波市海曙区中山西路 338 号                      | 0574-87259650  |
| 28 | 吉林省  | 中国民族证券有限责任公司通化新华大街证券营业部   | 通化市新华大街 66 号                          | 0435-3919150   |
| 29 |      | 中国民族证券有限责任公司通化新站路证券营业部    | 通化市新站路 31 号                           | 0435-3919150   |
| 30 |      | 中国民族证券有限责任公司辉南工农街证券营业部    | 辉南县朝阳镇工农街二委二组新古楼二楼                    | 0435-8245115   |
| 31 |      | 中国民族证券有限责任公司集安建设街证券营业部    | 吉林省通化市集安市建设街 599 号                    | 0435-6211615   |
| 32 |      | 中国民族证券有限责任公司长春西安大路证券营业部   | 长春市西安大路 1016 号                        | 0431-88966714  |
| 33 |      | 中国民族证券有限责任公司榆树中心街证券营业部    | 榆树市中心街 15 号                           | 0431-83626166  |
| 34 |      | 中国民族证券有限责任公司延吉友谊路证券营业部    | 延吉市友谊路 28 号大洲运动城 6 楼                  | 0433-2913510   |
| 35 |      | 天津市                       | 中国民族证券有限责任公司天津三马路证券营业部                | 天津市河北区三马路 89 号 |
| 36 | 湖南省  | 中国民族证券有限责任公司吉首人民北路证券营业部   | 吉首市人民北路 93 号财政大厦 2 楼                  | 0743-8265498   |
| 37 |      | 中国民族证券有限责任公司常德洞庭大道证券营业部   | 常德市武陵区穿紫河街道办事处贾家湖社区洞庭大道东润大厦 1 栋 101 号 | 0736-7272866   |
| 38 |      | 中国民族证券有限责任公司长沙车站北路证券营业部   | 长沙市车站北路 179 号                         | 0731-85867129  |
| 39 | 山东省  | 中国民族证券有限责任公司济南历山路证券营业部    | 济南市历下区历山路 185 号                       | 0531-82953230  |
| 40 | 四川省  | 中国民族证券有限责任公司成都沙湾路证券营业部    | 成都市金牛区沙湾路 268 号金贸大厦裙楼 3 楼             | 028-87649996   |
| 41 |      | 中国民族证券有限责任公司乐山大桥西街证券营业部   | 乐山市大桥西街 4 号                           | 0833-2139700   |
| 42 |      | 中国民族证券有限责任公司乐山柏杨证券营业部     | 乐山市柏杨东路 90 号金谊综合楼 2 楼                 | 0833-2431052   |
| 43 |      | 中国民族证券有限责任公司乐山小十字证券营业部    | 乐山市玉堂街 3 号 2 楼                        | 0833-2110308   |
| 44 |      | 中国民族证券有限责任公司峨眉金顶南路证券营业部   | 峨眉山市金顶南路 1 号综合楼 2-3 层                 | 0833-5534999   |
| 45 | 云南省  | 中国民族证券有限责任公司昆明西昌路证券营业部    | 云南省昆明市西昌路 26 号汇都首誉办公楼第 19 楼           | 0871-65398866  |
| 46 |      | 中国民族证券有限责任公司楚雄鹿城北路证券营业部   | 楚雄市鹿城镇鹿城北路 52 号森宝大厦二楼                 | 0878-3129977   |
| 47 | 新疆省  | 中国民族证券有限责任公司乌鲁木齐人民路证券营业部  | 乌鲁木齐市人民路 320 号                        | 0991-2845308   |
| 48 | 内蒙古省 | 中国民族证券有限责任公司呼和浩特新华东街证券营业部 | 呼和浩特市赛罕区新华东街 26 号万达广场 A 座十二层          | 0471-6283459   |
| 49 | 陕西省  | 中国民族证券有限责任公司西安高新路证券营业部    | 西安市高新区高新路 33 号新汇大厦 B 座                | 029-88326206   |
| 50 | 河北省  | 中国民族证券有限责任公司石家庄谈固西街证券营业部  | 石家庄市谈固西街 22 号                         | 0311-85064277  |
| 51 |      | 中国民族证券有限责任公司石家庄水源街证券营业部   | 石家庄市水源街 156 号                         | 0311-87823946  |

### 证券营业部（瑞信方正）

| 序号 | 区域  | 营业部名称         | 地址                                      | 联系电话          |
|----|-----|---------------|---|---------------|
| 1  | 广东省 | 瑞信方正深圳前海证券营业部 | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | 0755-66618587 |

# 审计报告

天健审（2017）2-176 号

方正证券股份有限公司全体股东：

我们审计了后附的方正证券股份有限公司（以下简称方正证券公司）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2016 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方正证券公司管理层的责任，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误导致的重大错报。

## 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，方正证券公司财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了方正证券公司 2016 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况，以及 2016 年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国·杭州

中国注册会计师：魏五军

中国注册会计师：张恩学

二〇一七年三月三十日

合并资产负债表  
2016 年 12 月 31 日

编制单位：方正证券股份有限公司

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                   | 1  | 31,653,009,147.22  | 47,771,925,975.36  |
| 其中：客户存款                |    | 27,761,569,446.51  | 38,969,220,903.63  |
| 结算备付金                  | 2  | 10,401,675,865.84  | 15,255,694,188.31  |
| 其中：客户备付金               |    | 7,323,109,424.95   | 11,313,376,316.42  |
| 拆出资金                   |    |                    |                    |
| 融出资金                   | 3  | 23,081,267,881.82  | 31,398,074,850.11  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4  | 35,133,307,565.31  | 25,019,830,145.82  |
| 衍生金融资产                 | 5  | 438,948.32         | 34,552,865.00      |
| 买入返售金融资产               | 6  | 12,215,615,748.75  | 5,534,275,243.41   |
| 应收款项                   | 7  | 1,253,956,700.86   | 375,289,398.50     |
| 应收利息                   | 8  | 1,447,446,362.79   | 1,468,800,916.99   |
| 存出保证金                  | 9  | 2,431,316,817.44   | 2,478,209,392.27   |
| 可供出售金融资产               | 10 | 26,483,424,940.30  | 16,160,875,630.78  |
| 持有至到期投资                | 11 | 807,508,824.56     | 1,506,828,351.55   |
| 长期股权投资                 | 12 | 15,636,004.13      | 46,749,480.08      |
| 投资性房地产                 | 13 | 220,423,285.04     | 275,719,048.18     |
| 固定资产                   | 14 | 491,289,314.38     | 473,206,826.76     |
| 在建工程                   | 15 | 7,111,307.66       | 10,554,805.53      |
| 无形资产                   | 16 | 160,777,329.40     | 154,715,251.48     |
| 商誉                     | 17 | 4,523,034,174.49   | 4,523,034,174.49   |
| 递延所得税资产                | 18 | 402,195,391.12     | 170,817,003.17     |
| 其他资产                   | 19 | 1,609,294,636.61   | 1,766,052,835.26   |
| 资产总计                   |    | 152,338,730,246.04 | 154,425,206,383.05 |
| <b>负债：</b>             |    |                    |                    |
| 短期借款                   |    |                    |                    |
| 应付短期融资款                | 21 | 11,039,500,000.00  | 5,528,760,000.00   |
| 拆入资金                   | 22 |                    | 552,000,000.00     |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 23 | 10,109,468,691.68  | 1,668,996,284.93   |
| 衍生金融负债                 | 5  | 520,977.80         | 6,396,708.27       |
| 卖出回购金融资产款              | 24 | 19,460,037,358.39  | 21,605,429,026.55  |
| 代理买卖证券款                | 25 | 30,832,708,036.73  | 47,238,807,439.34  |
| 代理承销证券款                |    |                    |                    |
| 应付职工薪酬                 | 26 | 1,142,427,749.57   | 1,925,286,089.82   |
| 应交税费                   | 27 | 195,977,926.95     | 317,341,725.37     |
| 应付款项                   | 28 | 7,357,311,486.55   | 5,320,149,484.08   |
| 应付利息                   | 29 | 1,488,474,836.34   | 1,858,397,898.23   |
| 预计负债                   | 30 | 293,797,870.07     | 306,151,267.39     |
| 长期应付职工薪酬               | 31 | 11,835,790.60      | 13,000,404.35      |
| 长期借款                   |    |                    |                    |

|                      |    |                    |                    |
|----------------------|----|--------------------|--------------------|
| 应付债券                 | 32 | 33,500,000,000.00  | 31,961,060,000.00  |
| 递延所得税负债              | 18 | 7,858,734.95       | 162,413,654.18     |
| 其他负债                 | 33 | 701,966,337.02     | 436,292,980.92     |
| 负债合计                 |    | 116,141,885,796.65 | 118,900,482,963.43 |
| 所有者权益（或股东权益）：        |    |                    |                    |
| 实收资本（或股本）            | 34 | 8,232,101,395.00   | 8,232,101,395.00   |
| 其他权益工具               |    |                    |                    |
| 资本公积                 | 35 | 16,426,028,946.43  | 16,426,028,946.43  |
| 减：库存股                |    |                    |                    |
| 其他综合收益               | 36 | -298,083,561.50    | 1,059,258,531.38   |
| 盈余公积                 | 37 | 1,114,985,003.34   | 909,954,123.09     |
| 一般风险准备               | 38 | 2,954,702,136.56   | 2,451,493,899.58   |
| 未分配利润                | 39 | 6,999,462,461.90   | 5,879,253,822.11   |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计 |    | 35,429,196,381.73  | 34,958,090,717.59  |
| 少数股东权益               |    | 767,648,067.66     | 566,632,702.03     |
| 所有者权益（或股东权益）合计       |    | 36,196,844,449.39  | 35,524,723,419.62  |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计    |    | 152,338,730,246.04 | 154,425,206,383.05 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

母公司资产负债表

2016 年 12 月 31 日

编制单位:方正证券股份有限公司

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                   | 1  | 19,354,200,395.87  | 28,953,127,306.81  |
| 其中:客户存款                |    | 17,192,865,356.52  | 23,612,984,127.88  |
| 结算备付金                  | 2  | 7,063,588,460.36   | 12,388,757,080.81  |
| 其中:客户备付金               |    | 4,374,675,790.06   | 7,956,077,404.01   |
| 拆出资金                   |    |                    |                    |
| 融出资金                   | 3  | 17,252,900,873.93  | 23,746,053,363.76  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4  | 20,304,389,459.12  | 19,107,760,937.56  |
| 衍生金融资产                 |    | 438,948.32         |                    |
| 买入返售金融资产               | 5  | 9,821,585,312.06   | 3,650,061,824.41   |
| 应收款项                   | 6  | 770,663,773.58     | 176,338,790.26     |
| 应收利息                   |    | 947,783,482.47     | 1,100,773,432.21   |
| 存出保证金                  |    | 188,486,354.05     | 351,624,447.93     |
| 可供出售金融资产               | 7  | 23,205,319,212.87  | 13,681,622,428.80  |
| 持有至到期投资                |    | 807,508,824.56     | 1,506,828,351.55   |
| 长期股权投资                 | 8  | 16,536,081,013.48  | 16,402,681,013.48  |
| 投资性房地产                 |    | 91,561,882.00      | 141,167,780.00     |
| 固定资产                   |    | 323,584,659.57     | 255,712,853.34     |
| 在建工程                   |    | 5,969,104.71       | 201,087.53         |
| 无形资产                   |    | 82,669,960.98      | 68,605,954.57      |
| 商誉                     |    |                    |                    |
| 递延所得税资产                |    | 240,508,717.94     | 28,973,727.48      |
| 其他资产                   |    | 1,248,447,958.26   | 112,827,377.04     |
| 资产总计                   |    | 118,245,688,394.13 | 121,673,117,757.54 |
| <b>负债:</b>             |    |                    |                    |
| 短期借款                   |    |                    |                    |
| 应付短期融资款                |    | 11,039,500,000.00  | 3,876,270,000.00   |
| 拆入资金                   |    |                    |                    |
| 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                 |    | 520,977.80         | 6,396,708.27       |
| 卖出回购金融资产款              | 9  | 16,625,225,835.61  | 19,250,060,453.55  |
| 代理买卖证券款                | 10 | 22,225,353,111.32  | 33,156,273,692.88  |
| 代理承销证券款                |    |                    |                    |
| 应付职工薪酬                 |    | 719,814,670.72     | 1,160,801,838.78   |
| 应交税费                   |    | 85,128,689.37      | 225,731,120.02     |
| 应付款项                   |    | 285,938,152.88     | 81,865,913.32      |
| 应付利息                   |    | 1,308,731,557.24   | 1,426,416,035.66   |
| 预计负债                   |    | 293,797,870.07     | 306,151,267.39     |
| 长期应付职工薪酬               |    | 11,835,790.60      | 13,000,404.35      |
| 长期借款                   |    |                    |                    |

|                       |  |                    |                    |
|-----------------------|--|--------------------|--------------------|
| 应付债券                  |  | 30,500,000,000.00  | 28,078,440,000.00  |
| 递延所得税负债               |  |                    |                    |
| 其他负债                  |  | 343,510,485.73     | 244,257,732.90     |
| 负债合计                  |  | 83,439,357,141.34  | 87,825,665,167.12  |
| 所有者权益（或股东权益）：         |  |                    |                    |
| 实收资本（或股本）             |  | 8,232,101,395.00   | 8,232,101,395.00   |
| 其他权益性工具               |  |                    |                    |
| 资本公积                  |  | 16,641,842,508.28  | 16,641,842,508.28  |
| 减：库存股                 |  |                    |                    |
| 其他综合收益                |  | -300,200,603.50    | 50,340,411.06      |
| 盈余公积                  |  | 1,114,218,789.43   | 909,187,909.18     |
| 一般风险准备                |  | 2,712,426,763.29   | 2,302,365,002.79   |
| 未分配利润                 |  | 6,405,942,400.29   | 5,711,615,364.11   |
| 所有者权益<br>（或股东权益）合计    |  | 34,806,331,252.79  | 33,847,452,590.42  |
| 负债和所有者权益<br>（或股东权益）总计 |  | 118,245,688,394.13 | 121,673,117,757.54 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

合并利润表  
2016 年 1—12 月

编制单位:方正证券股份有限公司

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                             |    | 7,759,896,839.14  | 10,914,989,706.62 |
| 手续费及佣金净收入                          | 1  | 4,551,146,729.83  | 7,515,649,593.57  |
| 其中:经纪业务手续费净收入                      |    | 3,662,159,567.10  | 6,899,959,235.17  |
| 投资银行业务手续费净收入                       |    | 581,827,025.98    | 363,900,109.81    |
| 资产管理业务手续费净收入                       |    | 171,463,261.04    | 99,826,691.71     |
| 利息净收入                              | 2  | 81,725,773.39     | 806,812,027.93    |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                    | 3  | 3,587,046,962.46  | 2,296,667,532.76  |
| 其中:对联营企业和合营企业的投资收益                 |    | -31,113,475.95    | -3,251,218.02     |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                | 4  | -499,509,770.07   | 224,787,917.57    |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列)                    |    | 2,620,958.21      | 1,850,758.19      |
| 其他业务收入                             | 5  | 36,866,185.32     | 69,221,876.60     |
| 二、营业支出                             |    | 4,609,271,132.49  | 5,394,190,047.02  |
| 税金及附加                              | 6  | 198,577,629.08    | 668,243,039.97    |
| 业务及管理费                             | 7  | 4,356,764,268.87  | 4,232,502,516.02  |
| 资产减值损失                             | 8  | 48,744,056.07     | 456,913,349.43    |
| 其他业务成本                             | 9  | 5,185,178.47      | 36,531,141.60     |
| 三、营业利润(亏损总额以“-”号填列)                |    | 3,150,625,706.65  | 5,520,799,659.60  |
| 加:营业外收入                            | 10 | 65,811,674.56     | 41,186,187.45     |
| 减:营业外支出                            | 11 | 54,317,965.31     | 114,521,441.74    |
| 四、利润总额(净亏损以“-”号填列)                 |    | 3,162,119,415.90  | 5,447,464,405.31  |
| 减:所得税费用                            | 12 | 579,797,104.99    | 1,348,970,822.74  |
| 五、净利润(净亏损以“-”号填列)                  |    | 2,582,322,310.91  | 4,098,493,582.57  |
| 归属于母公司所有者(或股东)的净利润                 |    | 2,569,336,882.57  | 4,064,211,991.64  |
| 少数股东损益                             |    | 12,985,428.34     | 34,281,590.93     |
| 六、其他综合收益的税后净额                      | 13 | -1,360,634,124.38 | 769,834,810.34    |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额               |    | -1,357,342,092.88 | 767,027,621.65    |
| (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                |    | -1,357,342,092.88 | 767,027,621.65    |
| 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                 |    | -1,362,502,188.59 | 764,847,386.89    |
| 3.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益            |    |                   |                   |
| 4.投资性房地产初始确认公允价值大于账面金额             |    | 24,667.74         |                   |
| 5.外币财务报表折算差额                       |    | 5,135,408.47      | 2,180,229.54      |
| 6.其他                               |    | 19.50             | 5.22              |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额                |    | -3,292,031.50     | 2,807,188.69      |
| 七、综合收益总额                           |    | 1,221,688,186.53  | 4,868,328,392.91  |

|                       |  |                  |                  |
|-----------------------|--|------------------|------------------|
| 归属于母公司所有者(或股东)的综合收益总额 |  | 1,211,994,789.69 | 4,831,239,613.29 |
| 归属于少数股东的综合收益总额        |  | 9,693,396.84     | 37,088,779.62    |
| 八、每股收益：               |  |                  |                  |
| （一）基本每股收益(元/股)        |  | 0.31             | 0.49             |
| （二）稀释每股收益(元/股)        |  | 0.31             | 0.49             |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

母公司利润表  
2016 年 1—12 月

编制单位:方正证券股份有限公司

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                              |    | 5,136,351,951.36 | 9,177,335,054.17 |
| 手续费及佣金净收入                           | 1  | 3,019,171,998.99 | 6,489,974,003.32 |
| 其中: 经纪业务手续费净收入                      |    | 2,661,395,910.29 | 6,206,084,852.94 |
| 投资银行业务手续费净收入                        |    | 192,048,630.89   | 129,485,408.06   |
| 资产管理业务手续费净收入                        |    | 152,691,275.45   | 78,743,043.86    |
| 利息净收入                               | 2  | -413,524,470.19  | 564,633,837.25   |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                     | 3  | 2,840,218,729.71 | 1,908,924,843.35 |
| 其中: 对联营企业和合营企业的投资收益                 |    |                  |                  |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                 |    | -328,058,543.85  | 192,398,614.11   |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列)                     |    | 1,356,954.90     | 1,027,656.26     |
| 其他业务收入                              |    | 17,187,281.80    | 20,376,099.88    |
| 二、营业支出                              |    | 2,792,565,193.67 | 3,620,127,263.32 |
| 税金及附加                               |    | 145,354,504.27   | 592,390,799.43   |
| 业务及管理费                              | 4  | 2,632,567,511.72 | 3,010,571,421.51 |
| 资产减值损失                              |    | 14,136,679.02    | 16,323,384.11    |
| 其他业务成本                              |    | 506,498.66       | 841,658.27       |
| 三、营业利润(亏损总额以“-”号填列)                 |    | 2,343,786,757.69 | 5,557,207,790.85 |
| 加: 营业外收入                            |    | 49,642,340.96    | 36,753,182.36    |
| 减: 营业外支出                            |    | 51,397,113.92    | 114,053,297.21   |
| 四、利润总额(净亏损以“-”号填列)                  |    | 2,342,031,984.73 | 5,479,907,676.00 |
| 减: 所得税费用                            |    | 291,723,182.25   | 1,359,338,434.63 |
| 五、净利润(净亏损以“-”号填列)                   |    | 2,050,308,802.48 | 4,120,569,241.37 |
| 六、其他综合收益的税后净额                       |    | -350,541,014.56  | -250,450,747.31  |
| (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                |    | -350,541,014.56  | -250,450,747.31  |
| 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                 |    | -350,541,014.56  | -250,450,747.31  |
| 3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益            |    |                  |                  |
| 4. 投资性房地产初始确认公允价值大于账面金额             |    |                  |                  |
| 5. 外币财务报表折算差额                       |    |                  |                  |
| 6. 其他                               |    |                  |                  |
| 七、综合收益总额                            |    | 1,699,767,787.92 | 3,870,118,494.06 |

法定代表人:高利

主管会计工作负责人:卫剑波

会计机构负责人:祖坤

合并现金流量表  
2016 年 1—12 月

编制单位:方正证券股份有限公司

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>      |    |                    |                    |
| 收取利息、手续费及佣金的现金             |    | 8,884,295,687.77   | 11,981,996,496.33  |
| 融出资金净减少额                   |    | 7,963,585,235.60   |                    |
| 拆入资金净增加额                   |    |                    |                    |
| 回购业务资金净增加额                 |    |                    |                    |
| 代理买卖证券收到的现金净额              |    |                    | 9,637,400,185.52   |
| 收到其他与经营活动有关的现金             | 1  | 11,431,630,603.14  | 3,927,791,747.60   |
| 经营活动现金流入小计                 |    | 28,279,511,526.51  | 25,547,188,429.45  |
| 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 |    | 9,169,718,600.93   | 15,733,360,407.51  |
| 融出资金净增加额                   |    |                    | 5,428,835,028.63   |
| 支付利息、手续费及佣金的现金             |    | 1,958,387,252.43   | 2,000,331,869.72   |
| 拆入资金净减少额                   |    | 552,000,000.00     | 3,301,000,000.00   |
| 回购业务资金净减少额                 |    | 8,826,732,173.50   | 3,519,604,265.47   |
| 代理买卖证券支付的现金净额              |    | 16,406,099,402.61  |                    |
| 支付给职工以及为职工支付的现金            |    | 3,517,607,083.70   | 2,074,218,157.58   |
| 支付的各项税费                    |    | 1,010,039,835.21   | 2,007,886,424.22   |
| 支付其他与经营活动有关的现金             | 2  | 11,693,649,653.45  | 5,986,793,221.57   |
| 经营活动现金流出小计                 |    | 53,134,234,001.83  | 40,052,029,374.70  |
| 经营活动产生的现金流量净额              |    | -24,854,722,475.32 | -14,504,840,945.25 |
| <b>二、投资活动产生的现金流量:</b>      |    |                    |                    |
| 收回投资收到的现金                  |    |                    | 7,200,000.00       |
| 取得投资收益收到的现金                |    | 86,230,218.00      | 93,263,437.14      |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额  |    | 2,935,311.56       | 17,927,486.72      |
| 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             | 3  | 896,304,000.00     | 26,811,638,633.79  |
| 投资活动现金流入小计                 |    | 985,469,529.56     | 26,930,029,557.65  |
| 投资支付的现金                    |    | 345,231,951.08     | 736,070,421.64     |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金    |    | 170,928,056.95     | 182,489,729.34     |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额        |    |                    |                    |
| 支付其他与投资活动有关的现金             | 4  |                    | 800,000,000.00     |
| 投资活动现金流出小计                 |    | 516,160,008.03     | 1,718,560,150.98   |
| 投资活动产生的现金流量净额              |    | 469,309,521.53     | 25,211,469,406.67  |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>      |    |                    |                    |
| 吸收投资收到的现金                  |    | 193,509,871.52     | 175,293,631.47     |
| 其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金        |    | 193,509,871.52     | 175,293,631.47     |
| 取得借款收到的现金                  |    |                    |                    |
| 发行债券收到的现金                  |    | 3,000,000,000.00   | 22,800,000,000.00  |
| 收到其他与筹资活动有关的现金             | 5  | 4,049,680,000.00   | 5,056,620,000.00   |
| 筹资活动现金流入小计                 |    | 7,243,189,871.52   | 28,031,913,631.47  |

|                     |  |                    |                   |
|---------------------|--|--------------------|-------------------|
| 偿还债务支付的现金           |  |                    | 3,000,000,000.00  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金   |  | 3,140,352,417.40   | 594,009,606.48    |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润 |  | 2,187,902.73       |                   |
| 支付其他与筹资活动有关的现金      |  |                    |                   |
| 筹资活动现金流出小计          |  | 3,140,352,417.40   | 3,594,009,606.48  |
| 筹资活动产生的现金流量净额       |  | 4,102,837,454.12   | 24,437,904,024.99 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响  |  | 7,756,366.68       | 34,207,907.58     |
| 五、现金及现金等价物净增加额      |  | -20,274,819,132.99 | 35,178,740,393.99 |
| 加：期初现金及现金等价物余额      |  | 62,178,347,277.31  | 26,999,606,883.32 |
| 六、期末现金及现金等价物余额      |  | 41,903,528,144.32  | 62,178,347,277.31 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

母公司现金流量表  
2016 年 1—12 月

编制单位:方正证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

| 项目                         | 附注 | 本期发生额              | 上期发生额             |
|----------------------------|----|--------------------|-------------------|
| 一、经营活动产生的现金流量:             |    |                    |                   |
| 以公允价值计量且其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             |    | 6,558,127,148.62   | 10,079,718,740.03 |
| 融出资金净减少额                   |    | 6,232,521,185.62   |                   |
| 拆入资金净增加额                   |    |                    |                   |
| 回购业务资金净增加额                 |    |                    |                   |
| 代理买卖证券收到的现金净额              |    |                    | 13,102,261,087.71 |
| 收到其他与经营活动有关的现金             | 1  | 1,145,828,596.07   | 3,060,854,520.00  |
| 经营活动现金流入小计                 |    | 13,936,476,930.31  | 26,242,834,347.74 |
| 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 |    | 479,239,666.25     | 17,042,370,523.02 |
| 融出资金净增加额                   |    |                    | 4,616,507,059.71  |
| 支付利息、手续费及佣金的现金             |    | 1,562,484,682.88   | 1,675,759,184.13  |
| 拆入资金净减少额                   |    |                    | 2,829,000,000.00  |
| 回购业务资金净减少额                 |    | 8,796,358,105.59   | 980,576,091.05    |
| 代理买卖证券支付的现金净额              |    | 10,930,920,581.56  |                   |
| 支付给职工以及为职工支付的现金            |    | 2,164,076,691.39   | 1,588,110,328.98  |
| 支付的各项税费                    |    | 673,192,906.43     | 1,830,859,080.55  |
| 支付其他与经营活动有关的现金             | 2  | 10,993,832,203.11  | 3,044,549,202.60  |
| 经营活动现金流出小计                 |    | 35,600,104,837.21  | 33,607,731,470.04 |
| 经营活动产生的现金流量净额              |    | -21,663,627,906.90 | -7,364,897,122.30 |
| 二、投资活动产生的现金流量:             |    |                    |                   |
| 收回投资收到的现金                  |    |                    |                   |
| 取得投资收益收到的现金                |    | 1,086,230,218.00   | 83,705,100.00     |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额  |    | 2,233,589.96       | 17,485,277.37     |
| 收到其他与投资活动有关的现金             | 3  | 96,304,000.00      |                   |
| 投资活动现金流入小计                 |    | 1,184,767,807.96   | 101,190,377.37    |
| 投资支付的现金                    |    | 133,400,000.00     | 727,129,765.92    |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金    |    | 128,826,495.82     | 126,683,093.05    |
| 支付其他与投资活动有关的现金             | 4  | 1,117,000,000.00   |                   |
| 投资活动现金流出小计                 |    | 1,379,226,495.82   | 853,812,858.97    |
| 投资活动产生的现金流量净额              |    | -194,458,687.86    | -752,622,481.60   |
| 三、筹资活动产生的现金流量:             |    |                    |                   |
| 吸收投资收到的现金                  |    |                    |                   |
| 取得借款收到的现金                  |    |                    |                   |
| 发行债券收到的现金                  |    | 3,000,000,000.00   | 22,800,000,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金             | 5  | 6,584,790,000.00   | 5,601,410,000.00  |
| 筹资活动现金流入小计                 |    | 9,584,790,000.00   | 28,401,410,000.00 |
| 偿还债务支付的现金                  |    |                    |                   |

|                    |  |                    |                   |
|--------------------|--|--------------------|-------------------|
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金  |  | 2,748,798,306.71   | 488,709,664.89    |
| 支付其他与筹资活动有关的现金     |  |                    |                   |
| 筹资活动现金流出小计         |  | 2,748,798,306.71   | 488,709,664.89    |
| 筹资活动产生的现金流量净额      |  | 6,835,991,693.29   | 27,912,700,335.11 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 |  | 1,356,954.90       | 33,420,898.58     |
| 五、现金及现金等价物净增加额     |  | -15,020,737,946.57 | 19,828,601,629.79 |
| 加：期初现金及现金等价物余额     |  | 41,294,748,056.82  | 21,466,146,427.03 |
| 六、期末现金及现金等价物余额     |  | 26,274,010,110.25  | 41,294,748,056.82 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

合并所有者权益（或股东权益）变动表

2016 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期数              |        |    |  |                   |       |                   |                  |                  |                   | 少数股东权益 | 所有者权益（或股东权益）合计 |                   |
|-----------------------|------------------|--------|----|--|-------------------|-------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|--------|----------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司所有者（或股东）权益 |        |    |  |                   |       |                   |                  |                  |                   |        |                |                   |
|                       | 股本               | 其他权益工具 |    |  | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益            | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润             |        |                | 其他                |
|                       | 优先股              | 永续债    | 其他 |  |                   |       |                   |                  |                  |                   |        |                |                   |
| 一、上年年末余额              | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,426,028,946.43 |       | 1,059,258,531.38  | 909,954,123.09   | 2,451,493,899.58 | 5,879,253,822.11  |        | 566,632,702.03 | 35,524,723,419.62 |
| 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              | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,426,028,946.43 |       | 1,059,258,531.38  | 909,954,123.09   | 2,451,493,899.58 | 5,879,253,822.11  |        | 566,632,702.03 | 35,524,723,419.62 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） |                  |        |    |  |                   |       | -1,357,342,092.88 | 205,030,880.25   | 503,208,236.98   | 1,120,208,639.79  |        | 201,015,365.63 | 672,121,029.77    |
| （一）综合收益总额             |                  |        |    |  |                   |       | -1,357,342,092.88 |                  |                  | 2,569,336,882.57  |        | 9,693,396.84   | 1,221,688,186.53  |
| （二）所有者投入和减少资本         |                  |        |    |  |                   |       |                   |                  |                  |                   |        | 193,509,871.52 | 193,509,871.52    |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |    |  |                   |       |                   |                  |                  |                   |        | 193,509,871.52 | 193,509,871.52    |
| 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               |                  |        |    |  |                   |       |                   | 205,030,880.25   | 503,208,236.98   | -1,449,128,242.78 |        | -2,187,902.73  | -743,077,028.28   |
| 1. 提取盈余公积             |                  |        |    |  |                   |       |                   | 205,030,880.25   |                  | -205,030,880.25   |        |                |                   |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |        |    |  |                   |       |                   |                  | 503,208,236.98   | -503,208,236.98   |        |                |                   |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       |                  |        |    |  |                   |       |                   |                  |                  | -740,889,125.55   |        | -2,187,902.73  | -743,077,028.28   |
| 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              | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,426,028,946.43 |       | -298,083,561.50   | 1,114,985,003.34 | 2,954,702,136.56 | 6,999,462,461.90  |        | 767,648,067.66 | 36,196,844,449.39 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

合并所有者权益（或股东权益）变动表

2016 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 上期数              |        |    |  |                   |       |                  |                |                  |                   | 少数股东权益 | 所有者权益（或股东权益）合计  |                   |
|-----------------------|------------------|--------|----|--|-------------------|-------|------------------|----------------|------------------|-------------------|--------|-----------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司所有者（或股东）权益 |        |    |  |                   |       |                  |                |                  |                   |        |                 |                   |
|                       | 股本               | 其他权益工具 |    |  | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益           | 盈余公积           | 一般风险准备           | 未分配利润             |        |                 | 其他                |
|                       | 优先股              | 永续债    | 其他 |  |                   |       |                  |                |                  |                   |        |                 |                   |
| 一、上年期末余额              | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,634,605,486.92 |       | 292,230,909.73   | 497,897,198.95 | 1,491,046,759.72 | 3,187,545,894.47  |        | 469,139,716.37  | 30,804,567,361.16 |
| 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              | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,634,605,486.92 |       | 292,230,909.73   | 497,897,198.95 | 1,491,046,759.72 | 3,187,545,894.47  |        | 469,139,716.37  | 30,804,567,361.16 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） |                  |        |    |  | -208,576,540.49   |       | 767,027,621.65   | 412,056,924.14 | 960,447,139.86   | 2,691,707,927.64  |        | 97,492,985.66   | 4,720,156,058.46  |
| （一）综合收益总额             |                  |        |    |  |                   |       | 767,027,621.65   |                |                  | 4,064,211,991.64  |        | 37,088,779.62   | 4,868,328,392.91  |
| （二）所有者投入和减少资本         |                  |        |    |  | -208,576,540.49   |       |                  |                |                  |                   |        | 60,404,206.04   | -148,172,334.45   |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |    |  |                   |       |                  |                |                  |                   |        | 175,293,631.47  | 175,293,631.47    |
| 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                 |                  |        |    |  | -208,576,540.49   |       |                  |                |                  |                   |        | -114,889,425.43 | -323,465,965.92   |
| （三）利润分配               |                  |        |    |  |                   |       |                  | 412,056,924.14 | 960,447,139.86   | -1,372,504,064.00 |        |                 |                   |
| 1. 提取盈余公积             |                  |        |    |  |                   |       |                  | 412,056,924.14 |                  | -412,056,924.14   |        |                 |                   |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |        |    |  |                   |       |                  |                | 960,447,139.86   | -960,447,139.86   |        |                 |                   |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       |                  |        |    |  |                   |       |                  |                |                  |                   |        |                 |                   |
| 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、本期末余额               | 8,232,101,395.00 |        |    |  | 16,426,028,946.43 |       | 1,059,258,531.38 | 909,954,123.09 | 2,451,493,899.58 | 5,879,253,822.11  |        | 566,632,702.03  | 35,524,723,419.62 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

母公司所有者权益（或股东权益）变动表  
2016 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期数              |        |     |    |                   |       |                 |                  |                  |                   |                   |
|-----------------------|------------------|--------|-----|----|-------------------|-------|-----------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
|                       | 股本               | 其他权益工具 |     |    | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润             | 所有者权益（或股东权益）合计    |
|                       |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                   |       |                 |                  |                  |                   |                   |
| 一、上年期末余额              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | 50,340,411.06   | 909,187,909.18   | 2,302,365,002.79 | 5,711,615,364.11  | 33,847,452,590.42 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |     |    |                   |       |                 |                  |                  |                   |                   |
| 前期差错更正                |                  |        |     |    |                   |       |                 |                  |                  |                   |                   |
| 其他                    |                  |        |     |    |                   |       |                 |                  |                  |                   |                   |
| 二、本年期初余额              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | 50,340,411.06   | 909,187,909.18   | 2,302,365,002.79 | 5,711,615,364.11  | 33,847,452,590.42 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） |                  |        |     |    |                   |       | -350,541,014.56 | 205,030,880.25   | 410,061,760.50   | 694,327,036.18    | 958,878,662.37    |
| （一）综合收益总额             |                  |        |     |    |                   |       | -350,541,014.56 |                  |                  | 2,050,308,802.48  | 1,699,767,787.92  |
| （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               |                  |        |     |    |                   |       |                 | 205,030,880.25   | 410,061,760.50   | -1,355,981,766.30 | -740,889,125.55   |
| 1. 提取盈余公积             |                  |        |     |    |                   |       |                 | 205,030,880.25   |                  | -205,030,880.25   |                   |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |        |     |    |                   |       |                 |                  | 410,061,760.50   | -410,061,760.50   |                   |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       |                  |        |     |    |                   |       |                 |                  |                  | -740,889,125.55   | -740,889,125.55   |
| 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              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | -300,200,603.50 | 1,114,218,789.43 | 2,712,426,763.29 | 6,405,942,400.29  | 34,806,331,252.79 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

母公司所有者权益（或股东权益）变动表  
2016 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 上期数              |        |     |    |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
|-----------------------|------------------|--------|-----|----|-------------------|-------|-----------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|
|                       | 股本               | 其他权益工具 |     |    | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积           | 一般风险准备           | 未分配利润             | 所有者权益（或股东权益）合计    |
|                       |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
| 一、上年期末余额              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | 300,791,158.37  | 497,130,985.04 | 1,478,251,154.51 | 2,827,216,895.16  | 29,977,334,096.36 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |     |    |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
| 前期差错更正                |                  |        |     |    |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
| 其他                    |                  |        |     |    |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
| 二、本年期初余额              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | 300,791,158.37  | 497,130,985.04 | 1,478,251,154.51 | 2,827,216,895.16  | 29,977,334,096.36 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） |                  |        |     |    |                   |       | -250,450,747.31 | 412,056,924.14 | 824,113,848.28   | 2,884,398,468.95  | 3,870,118,494.06  |
| （一）综合收益总额             |                  |        |     |    |                   |       | -250,450,747.31 |                |                  | 4,120,569,241.37  | 3,870,118,494.06  |
| （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               |                  |        |     |    |                   |       |                 | 412,056,924.14 | 824,113,848.28   | -1,236,170,772.42 |                   |
| 1. 提取盈余公积             |                  |        |     |    |                   |       |                 | 412,056,924.14 |                  | -412,056,924.14   |                   |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |        |     |    |                   |       |                 |                | 824,113,848.28   | -824,113,848.28   |                   |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       |                  |        |     |    |                   |       |                 |                |                  |                   |                   |
| 3. 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              | 8,232,101,395.00 |        |     |    | 16,641,842,508.28 |       | 50,340,411.06   | 909,187,909.18 | 2,302,365,002.79 | 5,711,615,364.11  | 33,847,452,590.42 |

法定代表人：高利

主管会计工作负责人：卫剑波

会计机构负责人：祖坤

## 方正证券股份有限公司

### 财务报表附注

2016 年度

金额单位：人民币元

#### 一、公司基本情况

方正证券股份有限公司(以下简称本公司或公司)的前身为浙江证券有限责任公司(以下简称浙江证券)。浙江证券系 1990 年经浙江省人民政府办公厅浙政办发〔1990〕47 号文批准,在原浙江省证券公司的基础上改组设立的地方性金融企业。1994 年 7 月 7 日经中国人民银行银复〔1994〕232 号文及中国人民银行浙江省分行浙银发〔1994〕331 号文批准,改组为有限责任公司,2003 年 4 月 16 日经浙江证券 2002 年度股东会决议批准,公司名称由浙江证券有限责任公司变更为方正证券有限责任公司。

2010 年 9 月 1 日经中国证监会《关于核准方正证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》(证监许可〔2010〕1199 号)核准、教育部科技发展中心《关于同意方正证券有限责任公司整体变更设立股份有限公司的批复》(科技发中心函〔2010〕44 号)同意,方正证券有限责任公司整体变更为股份有限公司。

2011 年,经中国证监会核准(证监许可〔2011〕1124 号),公司获准向社会公开发行人民币普通股(A 股)股票 1,500,000,000 股,每股面值 1 元。公司股票已于 2011 年 8 月 10 日在上海证券交易所挂牌交易。

公司现持有统一社会信用代码为 914300001429279950 的营业执照。公司现有注册资本 823,210.1395 万元,股份总数 823,210.1395 万股(每股面值 1 元)。其中,有限售条件的流通股份 A 股 194,225.0859 万股;无限售条件的流通股份 A 股 628,985.0536 万股。

本公司属金融行业。

本公司经营范围:证券经纪(除广东省深圳市前海深港现代服务业合作区之外);证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券自营;证券资产管理;融资融券;证券投资基金代销;为期货公司提供中间介绍业务;代销金融产品。(凭许可证经营,有效期至 2017 年 8 月 25 日)。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司拥有 7 家子公司，296 家证券营业部；拥有员工 7,777 人，其中高级管理人员 11 人。

本财务报表业经公司 2017 年 3 月 30 日第三届董事会第六次会议批准对外报出。

本公司将瑞信方正证券有限责任公司(以下简称瑞信方正公司)、方正富邦基金管理有限责任公司(以下简称方正富邦公司)、方正中期期货有限公司(以下简称方正中期公司)、中国民族证券有限责任公司(以下简称民族证券公司)和方正证券投资有限公司(以下简称方正投资公司)等 7 家子公司纳入本期合并财务报表范围。子公司及联营企业具体情况详见本财务报表附注在其他主体中的权益之说明。

## 二、财务报表的编制基础

### (一) 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

### (二) 持续经营能力评价

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营假设产生重大疑虑的事项或情况。

## 三、重要会计政策和会计估计

重要提示：本公司根据实际经营特点针对应收款坏账准备的计提、可供出售金融资产减值准备计提、固定资产折旧、无形资产摊销等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

### (一) 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

### (二) 会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### (三) 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

### (四) 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的会计处理方法

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方在最终控制方合并财务报表

中的账面价值计量。公司按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值份额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；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

## 2. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对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；如果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，首先对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以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍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，其差额计入当期损益。

### (五) 合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

### (六) 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、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。本公司现金主要包括：现金、银行存款、其他货币资金、结算备付金等。

### (七) 外币业务和外币报表折算

#### 1. 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日的即期汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

#### 2. 外币财务报表折算

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；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费

用项目，采用交易发生日的即期汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

#### (八) 客户交易结算资金

本公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，与自有资金分开管理，为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入交易所指定的清算代理机构，在结算备付金中核算。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债，公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

#### (九) 金融工具

##### 1. 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：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、可供出售金融资产。

##### 1) 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资产包括交易性金融资产和在初始确认时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。

##### ① 交易性金融资产

公司将满足下列条件之一的金融资产划分为交易性金融资产：

- A. 取得该金融资产的目的主要是为了近期内出售、回购或赎回；
- B. 属于进行集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且公司近期采用短期获利方式对该组合进行管理；
- C. 属于衍生工具。

##### ② 在初始确认时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

A. 对于包括一项或多项嵌入衍生工具的混合工具，如果不是以下两种情况，公司将其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：a. 嵌入衍生工具对混合工具的现金流量没有重大改变；b. 类似混合工具所嵌入的衍生工具，明显不应当从相关混合工具中分拆。

B. 除混合工具以外的其他金融资产，当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能够产生更相关的会计信息，则将其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。符合下列条件之一，表明直接指定能产生更相关的会计信息：a. 该指定可以消除或明显减少由于该金融资产的计量基础不同而导致的相关利得或损失在确认和计量方面不一致的情况；b. 公司的风险管理或投资策略的正式书面文件已载明，该金融资产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。

#### 2) 持有至到期投资

公司将到期日固定、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划分为持有至到期投资。

#### 3) 贷款和应收款

公司将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划分为贷款和应收款。

#### 4) 可供出售金融资产

对于公允价值能够可靠计量的金融资产，且公司没有将其划分为其他三类的，公司将其直接指定为可供出售金融资产。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：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在初始确认时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。

#### 2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

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。初始确认金融资产或金融负债时，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和金融负债，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。

公司按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 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，按照成本计量。

公司采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定

为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1) 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；2) 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(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，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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。

### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给了转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：(1) 放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；(2) 未放弃对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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的公允价值变动累计额之和。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，并将下列两项金额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的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

#### 4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

(1) 第一层次输入值是在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；

(2) 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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

(3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

#### 5. 金融资产的减值测试和减值准备计提方法

(1) 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，如有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备。

(2) 对于持有至到期投资、贷款和应收款，先将单项金额重大的金融资产区分开来，单独进行减值测试；对单项金额不重大的金融资产，可以单独进行减值测试，或包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中进行减值测试；单独测试未发生减值的金融资产(包括单项金额重大和不重大的金融资产)，包括在具有类似信用风险特征的金融资产组合中再进行减值测试。测试结果表明其发生了减值的，根据其账面价值高于预计未来现金流量现值的差额确认减值损失。

#### (3) 可供出售金融资产

1) 表明可供出售债务工具投资发生减值的客观证据包括：

- ① 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；
- ③ 公司出于经济或法律等方面因素的考虑，对发生财务困难的债务人作出让步；
- ④ 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- ⑤ 因债务人发生重大财务困难，该债务工具无法在活跃市场继续交易；
- ⑥ 其他表明可供出售债务工具已经发生减值的情况。

2) 表明可供出售权益工具投资发生减值的客观证据包括权益工具投资的公允价值发生严重或非暂时性下跌, 以及被投资单位经营所处的技术、市场、经济或法律环境等发生重大不利变化使公司可能无法收回投资成本。

本公司于资产负债表日对各项可供出售权益工具投资单独进行检查。对于以公允价值计量的权益工具投资, 若其于资产负债表日的公允价值低于其成本超过 50%(含 50%)或低于其成本持续时间超过 12 个月(含 12 个月)的, 则表明其发生减值; 若其于资产负债表日的公允价值低于其成本超过 20%(含 20%)但尚未达到 50%的, 或低于其成本持续时间超过 6 个月(含 6 个月)但未超过 12 个月的, 本公司会综合考虑其他相关因素, 诸如价格波动率等, 判断该权益工具投资是否发生减值。对于本公司投资于中国证券金融股份有限公司(以下简称证金公司)统一运作的专户, 鉴于其投资目的、投资管理决策模式和处置的特殊性, 并结合行业惯例作法, 本公司以该项投资公允价值跌幅超过成本的 50%, 或者持续下跌时间达 36 个月以上, 为确认减值损失的判断标准。对于以成本计量的权益工具投资, 公司综合考虑被投资单位经营所处的技术、市场、经济或法律环境等是否发生重大不利变化, 判断该权益工具是否发生减值。

以公允价值计量的可供出售金融资产发生减值时, 原直接计入其他综合收益的因公允价值下降形成的累计损失予以转出并计入减值损失。对已确认减值损失的可供出售债务工具投资, 在期后公允价值回升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的, 原确认的减值损失予以转回并计入当期损益。对已确认减值损失的可供出售权益工具投资, 期后公允价值回升直接计入其他综合收益。

以成本计量的可供出售权益工具发生减值时, 将该权益工具投资的账面价值, 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, 发生的减值损失一经确认, 不予转回。

#### (十) 应收款项

##### 1. 单项金额重大并单项计提坏账准备的应收款项

|                      |  |
|----------------------|--|
| 单项金额重大的判断依据或金额标准     | 单项金额 500 万元以上款项。                       |
| 单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法 | 单独进行减值测试, 根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备。 |

##### 2. 按组合计提坏账准备的应收款项

###### (1) 具体组合及坏账准备的计提方法

按信用风险特征组合计提坏账准备的计提方法

确定组合的依据：

|             |                                  |
|-------------|----------------------------------|
| 应收期货业务保证金组合 | 期货业务产生的应收保证金                     |
| 应收投资银行业务组合  | 承销保荐、财务顾问等业务形成的应收款项              |
| 应收基金管理业务组合  | 基金管理业务产生的应收所管理基金的管理费             |
| 应收融资融券业务组合  | 融券融券业务产生的应收款项                    |
| 账龄组合        | 账龄为信用风险特征                        |
| 内部往来组合      | 合并报表范围内往来款                       |
| 单项不重大组合     | 单项金额不重大的款项，且有确凿证据表明无法收回或收回的可能性较低 |

按组合计提坏账准备的计提方法：

|             |                  |
|-------------|------------------|
| 应收期货业务保证金组合 | 信用风险较小，不计提坏账准备   |
| 应收投资银行业务组合  | 如无减值迹象，不计提坏账准备   |
| 应收基金管理业务组合  | 如无减值迹象，不计提坏账准备   |
| 应收融资融券业务组合  | 根据未来可回收金额，计提减值准备 |
| 账龄组合        | 账龄分析法            |
| 内部往来组合      | 如无减值迹象，不计提坏账准备   |
| 单项不重大组合     | 按个别认定法计提         |

(2) 账龄分析法

| 账 龄               | 应收账款计提比例 (%) | 其他应收款计提比例 (%) |
|-------------------|--------------|---------------|
| 1 年以内 (含 1 年，以下同) | 5            | 5             |
| 1-2 年             | 10           | 10            |
| 2-3 年             | 20           | 20            |
| 3-4 年             | 60           | 60            |
| 4-5 年             | 80           | 80            |
| 5 年以上             | 100          | 100           |

对应收利息等其他应收款项，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备。

(十一) 证券承销业务核算方法

本公司证券承销的方式包括余额包销和代销,于承销业务提供的相关服务完成时确认收入。在余额包销方式下,对发行期结束后未售出的证券按约定的发行价格转为交易性金融资产、可供出售金融资产等。

本公司将在发行项目立项之前的相关费用计入当期损益。在项目立项之后,将可单独辨认的发行费用记入待转承销费用科目,待项目成功发行后,结转损益。所有已确认不能成功发行的项目费用记入当期损益。

#### (十二) 代兑付债券业务核算方法

公司接受委托对委托方发行的债券到期进行兑付时,在代兑付债券业务提供的相关服务完成时确认收入。

#### (十三) 买入返售与卖出回购款项的核算方法

买入返售交易是指按照合同或协议以一定的价格向交易对手买入相关资产(包括债券及票据),合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账,在资产负债表“买入返售金融资产”项目列示。

卖出回购交易是指按照合同或协议以一定的价格将相关的资产(包括债券和票据)出售给交易对手,到合同或协议到期日,再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账,在资产负债表“卖出回购金融资产款”项目列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内,并按照相关的会计政策核算。

买入返售及卖出回购的利息收支,在返售或回购期间内以实际利率确认。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支。

#### (十四) 客户资产管理业务核算方法

公司客户资产管理业务分为定向资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体,单独建账、独立核算,单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算,比照证券投资基金会计核算办法进行,并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映,在财务报表附注中列示,详见本财务报表附注其他重要事项之受托客户资产管理业务。

#### (十五) 融资融券业务

融资融券业务，是指公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。公司发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

融资业务，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。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，融出的证券按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定，不终止确认该证券，并确认相应利息收入。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

#### （十六）转融通业务核算方法

公司通过证券金融公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，不将其计入资产负债表。

公司根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

#### （十七）协议安排业务核算方法

公司通过协议安排将自身所持有证券价格波动的风险和报酬转移给他方的，根据《企业会计准则第23号——金融资产转移》的相关规定判断是否应终止确认相关证券；反之，公司虽然名义上未持有证券，但通过协议安排在实质上承担了该证券价格波动的风险和报酬的，根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》的相关规定判断是否应确认一项金融资产或负债。

#### （十八）发起设立或发行产品业务核算方法

公司发起设立资产管理分级产品，并以自有资金认购次级部分，依据管理层持有意图，通过相关金融资产科目核算自有资金认购部分，并根据承担风险的程度，确认相应的预计负债。

向客户发行的各类产品(非资产管理产品)，通过产品销售合同等文件或交易模式等方法，承诺或保证本金安全的，判断该项业务的实质，如属于融资业务的，纳入资产负债表核算。

#### （十九）划分为持有待售的资产

公司将同时满足下列条件的非流动资产(不包含金融资产)划分为持有待售的资产：1. 该组成部分必须在其当前状况下仅根据出售此类组成部分的通常和惯用条款即可立即出售；

2. 已经就处置该组成部分作出决议；3. 与受让方签订了不可撤销的转让协议；4. 该项转让很可能在一年内完成。

## （二十）长期股权投资

### 1. 共同控制、重要影响的判断

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，认定为共同控制。对被投资单位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，认定为重大影响。

### 2. 投资成本的确定

（1）同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的面值总额之间的差额调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

（2）非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

（3）除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第 12 号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》确定其初始投资成本。

### 3. 后续计量及损益确认方法

对被投资单位实施控制的长期股权投资采用成本法核算；对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。

## （二十一）投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权和已出租的建筑物。

2. 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用公允价值模式进行后续计量。

本公司按照公允价值核算的投资性房地产均位于当地的商业中心，具有活跃的房地产交易，公司能够获取同类或类似房地产市场价格及其他信息作为公允价值估计的依据。同时，

公司每年聘请专业的评估机构对期末投资性房地产价值进行评估，确定期末的价值。

公司聘请专业的评估机构对期末投资性房地产价值进行评估为最佳估计。国家宏观调控、房产的区位条件变化，可能导致房产的市场价值发生变化。

## （二十二）固定资产

### 1. 固定资产确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

### 2. 各类固定资产的折旧方法

| 项 目    | 折旧方法  | 折旧年限(年) | 残值率(%) | 年折旧率(%) |
|--------|-------|---------|--------|---------|
| 房屋及建筑物 | 年限平均法 | 20      | 3      | 4.85    |
| 机器设备   | 年限平均法 | 10      | 3      | 9.70    |
| 电子设备   | 年限平均法 | 5       | 3      | 19.40   |
| 运输设备   | 年限平均法 | 5       | 3      | 19.40   |
| 办公设备   | 年限平均法 | 5       | 3      | 19.40   |
| 其他设备   | 年限平均法 | 5       | 3      | 19.40   |

## （二十三）在建工程

1. 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

## （二十四）借款费用

### 1. 借款费用资本化的确认原则

公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时确认为费用，计入当期损益。

### 2. 借款费用资本化期间

(1) 当借款费用同时满足下列条件时，开始资本化：1) 资产支出已经发生；2) 借款费用已经发生；3) 为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开

始。

(2) 若符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断,并且中断时间连续超过 3 个月,暂停借款费用的资本化;中断期间发生的借款费用确认为当期费用,直至资产的购建或者生产活动重新开始。

(3) 当所购建或者生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或可销售状态时,借款费用停止资本化。

### 3. 借款费用资本化金额

为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的,以专门借款当期实际发生的利息费用(包括按照实际利率法确定的折价或溢价的摊销),减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额,确定应予资本化的利息金额;为购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的,根据累计资产支出超过专门借款的资产支出加权平均数乘以占用一般借款的资本化率,计算确定一般借款应予资本化的利息金额。

### (二十五) 无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、交易席位以及软件等,按成本进行初始计量。

2. 使用寿命有限的无形资产,在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销,无法可靠确定预期实现方式的,采用直线法摊销。具体年限如下:

(1) 软件费用,按不超过 5 年摊销;

(2) 交易席位费、高尔夫会籍视为使用寿命不确定的无形资产,不进行摊销。席位费实行附属台账登记,直至转让收回;

(3) 取得的土地使用权,按照土地使用权使用年限平均摊销;若改变土地使用权用途,用于赚取租金或资本增值的,将其转为投资性房地产核算。

购入的交易席位费按取得时的实际成本计价,作为一项使用寿命不确定的无形资产核算对使用寿命不确定的无形资产。使用寿命不确定的无形资产不摊销,公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。

购入的交易席位费使用寿命不确定的判断依据:购入的交易席位费是公司购买的一项特许权利,无明确的法定寿命;交易席位为目前证券代理交易的必须的一项权利,能够为公司带来经济利益的流入,如现有的证券代理模式不改变,交易席位将拥有较长的经济寿命。

## （二十六）部分长期资产减值

对长期股权投资、固定资产、在建工程和使用寿命有限的无形资产等长期资产,在资产负债表日有迹象表明发生减值的,估计其可收回金额。对因企业合并所形成的商誉和使用寿命不确定的无形资产,无论是否存在减值迹象,每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的,按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

## （二十七）长期待摊费用

长期待摊费用核算已经支出,摊销期限在 1 年以上(不含 1 年)的各项费用。长期待摊费用按实际发生额入账,在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

## （二十八）职工薪酬

1. 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。
2. 短期薪酬的会计处理方法

在职工为公司提供服务的会计期间,将实际发生的短期薪酬确认为负债,并计入当期损益或相关资产成本。

### 3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

(1) 在职工为公司提供服务的会计期间,根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债,并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤:

1) 根据预期累计福利单位法,采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等作出估计,计量设定受益计划所产生的义务,并确定相关义务的所属期间。同时,对设定受益计划所产生的义务予以折现,以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本;

2) 设定受益计划存在资产的,将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的,以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产;

3) 期末,将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分,其

中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

#### 4. 辞退福利的会计处理方法

向职工提供的辞退福利，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：(1) 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；(2) 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。

#### 5. 其他长期职工福利的会计处理方法

向职工提供的其他长期福利，符合设定提存计划条件的，按照设定提存计划的有关规定进行会计处理；除此之外的其他长期福利，按照设定受益计划的有关规定进行会计处理，为简化相关会计处理，将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动等组成项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

### (二十九) 预计负债

1. 因对外提供担保、诉讼事项、产品质量保证、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。

2. 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

### (三十) 收入

#### 1. 手续费及佣金收入

(1) 代理买卖证券业务收入，在代买卖证券交易日确认收入。

(2) 证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：1) 采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；2) 采用余额包销、代销方式的，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。

(3) 受托客户资产管理业务收入，在资产管理合同到期或者定期与委托单位结算收益或损失时，按合同规定收益分成方式和比例计算的应该享有的收益或承担的损失，确认为受托投资管理手续费及佣金收入。

#### 2. 利息收入

在相关的收入能够可靠计量，相关的经济利益能够收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认当期利息收入；在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期利息收入。

融出资金、融出证券按资金使用时间和约定的利率确认当期利息收入。

### 3. 其他业务收入

其他业务收入反映公司从事除证券经营业务以外的其他业务实现的收入，包括出租固定资产、出租无形资产或债务重组等实现的收入以及投资性房地产取得的租金收入，该等收入于劳务已提供、资产已转让、收到价款或取得收取款项的证据时确认收入。

#### (三十一) 政府补助

##### 1. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。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。

##### 2. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，在确认相关费用的期间，计入当期损益；用于补偿已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

#### (三十二) 递延所得税资产、递延所得税负债

1. 根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额(未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的，该计税基础与其账面数之间的差额)，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

2. 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。资产负债表日，有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。

3. 资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核，如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，转回减记的金额。

4. 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列

情况产生的所得税：(1) 企业合并；(2) 直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

### (三十三) 租赁

公司为承租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金计入相关资产成本或确认为当期损益，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。

### (三十四) 一般风险准备金和交易风险准备金

公司的一般风险准备分为一般风险准备金和交易风险准备金。本公司及相关子公司按当年实现净利润（减弥补亏损）的 10% 计提一般风险准备金，按照不低于净利润（减弥补亏损）的 10% 计提交易风险准备金。

本公司子公司方正富邦公司根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》等的规定，每月按照不得低于基金管理费收入 10% 的比例计提风险准备金。

### (三十五) 分部报告

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，本公司的经营分部是指同时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. 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
3. 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

当存在相似经济特征的两个或多个经营分部，同时满足下列条件的，可以合并为一个经营分部：1. 各单项产品或劳务的性质相同或相似；2. 生产过程的性质相同或相似；3. 产品或劳务的客户类型相同或相似；4. 销售产品或提供劳务的方式相同或相似；5. 生产产品或提供劳务受法律、行政法规的影响相同或相似。

本公司以经营分部为基础确定报告分部，分部会计政策与合并财务报表会计政策一致。分部间转移价格参照市场价格确定，与各分部共同使用的资产、相关的费用按照收入比例在不同的分部之间分配。

## 四、税(费)项

### (一) 主要税种及税率

| 税 种      | 计 税 依 据 | 税 率      |
|----------|---------|----------|
| 增值税[注 1] | 应税收入    | 6%、5%、3% |

| 税 种        | 计 税 依 据   | 税 率           |
|------------|---|---------------|
| 营业税        | 应纳税营业额  | 5%            |
| 房产税        | 从价计征的，按房产原值一定比例扣除后余值的 1.2%计缴；从租计征的，按租金收入的 12%计缴 | 1.2%、12%      |
| 城市维护建设税    | 应缴流转税税额   | 7%、5%         |
| 教育费附加      | 应缴流转税税额   | 3%            |
| 地方教育附加     | 应缴流转税税额   | 1%、1.5%、2%、3% |
| 企业所得税[注 2] | 应纳税所得额  | 9%、16.5%、25%  |

[注 1]：根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕70 号)等规定，自 2016 年 5 月 1 日起，本公司的主营业务收入适用增值税，税率为 6%。2016 年 5 月 1 日前该部分业务适用营业税，税率为 5%。

根据财政部和国家税务总局 2016 年 12 月 21 日发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税税收政策的通知》，纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于财税〔2016〕36 号的金融商品转让。资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部和国家税务总局 2017 年 1 月 6 日发布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳。

[注 2]：母公司及全资子公司民族证券公司以及控股子公司方正中期公司下属分支机构按照国家税务总局公告《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法》(〔2012〕57 号)的规定，实行就地预缴、汇总清算的所得税缴纳政策，税率为 25%。

其他不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

| 纳税主体名称           | 所得税税率 |
|------------------|-------|
| 方正证券(香港)金融控股有限公司 | 16.5% |
| 方正和生投资有限责任公司     | 9%    |
| 除上述以外的其他纳税主体     | 25%   |

(二) 税收优惠

### 1. 营业税

(1) 根据财政部、国家税务总局《关于证券投资者保护基金有关营业税问题的通知》(财税〔2006〕172 号)和《关于中国证券投资者保护基金有限责任公司有关税收问题的补充通知》(财税〔2008〕78 号), 准许证券公司上缴的证券投资者保护基金从其营业税计税营业额中扣除。

(2) 根据《国家税务总局关于金融商品转让业务有关营业税问题的公告》(国家税务总局公告 2013 年第 63 号), 公司不同品种金融商品买卖出现的正负差, 准许在同一个纳税期内相抵, 按盈亏相抵后的余额为营业额计算缴纳营业税。

### 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局《关于印发〈营业税改征增值税试点方案〉的通知》(财税〔2011〕110 号)和《关于在北京等 8 省市开展交通运输业和部分现代服务业营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2012〕71 号), 自 2012 年 12 月 21 日公司成立之日起, 方正富邦公司的全资子公司北京方正富邦创融资产管理有限公司的财务顾问业务收入适用增值税, 小规模纳税人采用简易计税方法, 征收率为 3%。

### 3. 企业所得税

全资子公司方正和生投资有限责任公司于 2015 年 11 月将注册登记地由北京转为西藏自治区, 根据《西藏自治区人民政府关于印发西藏自治区企业所得税政策实施办法的通知》(藏政发〔2014〕51 号), 公司适用 15% 的税率征收企业所得税; 根据《西藏拉萨经济技术开发区关于支持入区企业发展的若干意见(暂行)》第四条中“自 2015 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止, 暂免征收经开区企业应缴纳的企业所得税中属于地方分享的部分”, 因此, 方正和生投资有限责任公司暂免缴纳 40% 地方分享部分企业所得税, 即按照 9% 的税率征收企业所得税。

## 五、合并财务报表项目注释

### (一) 合并资产负债表项目注释

#### 1. 货币资金

##### (1) 类别明细

| 项 目  | 期末数        | 期初数        |
|------|------------|------------|
| 库存现金 | 336,664.68 | 370,186.40 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 银行存款          | 31,642,485,523.49 | 47,740,372,765.36 |
| 其中：客户存款       | 27,761,569,446.51 | 38,969,220,903.63 |
| 公司存款          | 3,880,916,076.98  | 8,771,151,861.73  |
| 其他货币资金        | 10,186,959.05     | 31,183,023.60     |
| 合 计           | 31,653,009,147.22 | 47,771,925,975.36 |
| 其中：存放在境外的款项总额 | 94,070,916.74     | 95,879,365.85     |

(2) 币种明细

| 项 目       | 期末数            |        |                   |
|-----------|----------------|--------|-------------------|
|           | 原币金额           | 汇率     | 人民币金额             |
| 库存现金：     |                |        |                   |
| 人民币       |                |        | 174,625.87        |
| 美元        | 21,658.86      | 6.9370 | 150,247.51        |
| 港币        | 13,182.00      | 0.8945 | 11,791.30         |
| 小 计       |                |        | 336,664.68        |
| 银行存款：     |                |        |                   |
| 其中：客户资金存款 |                |        |                   |
| 人民币       |                |        | 27,171,429,160.40 |
| 美元        | 66,795,129.09  | 6.9370 | 463,357,810.45    |
| 港币        | 141,735,143.04 | 0.8945 | 126,782,475.66    |
| 小 计       |                |        | 27,761,569,446.51 |
| 自有资金存款    |                |        |                   |
| 人民币       |                |        | 3,824,072,470.97  |
| 美元        | 3,709,299.83   | 6.9370 | 25,731,412.92     |
| 港币        | 34,781,293.79  | 0.8945 | 31,112,193.09     |
| 小 计       |                |        | 3,880,916,076.98  |
| 银行存款合计    |                |        | 31,642,485,523.49 |
| 其他货币资金：   |                |        |                   |
| 人民币       |                |        | 10,186,959.05     |
| 小 计       |                |        | 10,186,959.05     |

| 项 目        | 期末数            |        |                   |
|------------|----------------|--------|-------------------|
|            | 原币金额           | 汇率     | 人民币金额             |
| 合 计        |                |        | 31,653,009,147.22 |
| (续上表)      |                |        |                   |
| 项 目        | 期初数            |        |                   |
|            | 原币金额           | 汇率     | 人民币金额             |
| 库存现金:      |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 218,498.55        |
| 美元         | 21,658.86      | 6.4936 | 140,643.97        |
| 港币         | 13,182.00      | 0.8378 | 11,043.88         |
| 小 计        |                |        | 370,186.40        |
| 银行存款:      |                |        |                   |
| 其中: 客户资金存款 |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 38,347,019,678.96 |
| 美元         | 73,215,553.92  | 6.4936 | 475,432,520.93    |
| 港币         | 175,184,254.21 | 0.8378 | 146,768,703.74    |
| 小 计        |                |        | 38,969,220,903.63 |
| 自有资金存款     |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 8,686,617,316.25  |
| 美元         | 2,268,180.28   | 6.4936 | 14,728,655.47     |
| 港币         | 83,322,409.21  | 0.8378 | 69,805,890.01     |
| 小 计        |                |        | 8,771,151,861.73  |
| 银行存款合计     |                |        | 47,740,372,765.36 |
| 其他货币资金:    |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 31,183,023.60     |
| 小 计        |                |        | 31,183,023.60     |
| 合 计        |                |        | 47,771,925,975.36 |

(3) 融资融券业务信用资金明细情况

| 项 目 | 期末数  |    |       |
|-----|------|----|-------|
|     | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |

|         |  |  |                  |
|---------|--|--|------------------|
| 客户信用资金： |  |  |                  |
| 人民币     |  |  | 2,847,631,074.13 |
| 小 计     |  |  | 2,847,631,074.13 |
| 公司信用资金： |  |  |                  |
| 人民币     |  |  | 3,187,744.78     |
| 小 计     |  |  | 3,187,744.78     |
| 总 计     |  |  | 2,850,818,818.91 |

(续上表)

| 项 目     | 期初数  |    |                  |
|---------|------|----|------------------|
|         | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额            |
| 客户信用资金： |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 3,026,909,633.84 |
| 小 计     |      |    | 3,026,909,633.84 |
| 公司信用资金： |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 18,051,158.44    |
| 小 计     |      |    | 18,051,158.44    |
| 总 计     |      |    | 3,044,960,792.28 |

(4) 其他说明

货币资金使用受限情况详见本附注五(四)之所有权或使用权受到限制的资产。

## 2. 结算备付金

(1) 按类别明细

| 项 目   | 期末数               | 期初数               |
|-------|-------------------|-------------------|
| 客户备付金 | 7,323,109,424.95  | 11,313,376,316.42 |
| 公司备付金 | 3,078,566,440.89  | 3,942,317,871.89  |
| 合 计   | 10,401,675,865.84 | 15,255,694,188.31 |

(2) 按币种明细

| 项 目 | 期末数  |    |       |
|-----|------|----|-------|
|     | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |

客户普通备付金：

| 项 目      | 期末数           |        |                   |
|----------|---------------|--------|-------------------|
|          | 原币金额          | 汇率     | 人民币金额             |
| 人民币      |               |        | 7,154,595,138.59  |
| 美元       | 21,332,169.09 | 6.9370 | 147,981,256.98    |
| 港币       | 22,954,756.16 | 0.8945 | 20,533,029.38     |
| 小 计      |               |        | 7,323,109,424.95  |
| 客户备付金合计  |               |        | 7,323,109,424.95  |
| 公司普通备付金： |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 1,746,469,152.54  |
| 小 计      |               |        | 1,746,469,152.54  |
| 公司信用备付金： |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 1,332,097,288.35  |
| 小 计      |               |        | 1,332,097,288.35  |
| 公司备付金合计  |               |        | 3,078,566,440.89  |
| 总 计      |               |        | 10,401,675,865.84 |
| (续上表)    |               |        |                   |
| 项 目      | 期初数           |        |                   |
|          | 原币金额          | 汇率     | 人民币金额             |
| 客户普通备付金： |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 11,087,053,586.91 |
| 美元       | 30,205,440.96 | 6.4936 | 196,142,051.42    |
| 港币       | 36,023,726.53 | 0.8378 | 30,180,678.09     |
| 小 计      |               |        | 11,313,376,316.42 |
| 客户备付金合计  |               |        | 11,313,376,316.42 |
| 公司普通备付金： |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 756,699,928.55    |
| 小 计      |               |        | 756,699,928.55    |
| 公司信用备付金： |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 3,185,617,943.34  |

| 项 目     | 期初数  |    |                   |
|---------|------|----|-------------------|
|         | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额             |
| 小 计     |      |    | 3,185,617,943.34  |
| 公司备付金合计 |      |    | 3,942,317,871.89  |
| 总 计     |      |    | 15,255,694,188.31 |

### 3. 融出资金

#### (1) 明细情况——按类别

| 项 目        | 期末数               | 期初数               |
|------------|-------------------|-------------------|
| 融资融券业务融出资金 | 23,081,267,881.82 | 31,398,074,850.11 |
| 减：减值准备     |                   |                   |
| 合 计        | 23,081,267,881.82 | 31,398,074,850.11 |

#### (2) 明细情况——按客户

| 项 目  | 期末数               | 期初数               |
|------|-------------------|-------------------|
| 个人客户 | 22,703,884,035.54 | 30,637,115,427.88 |
| 机构客户 | 377,383,846.28    | 760,959,422.23    |
| 合 计  | 23,081,267,881.82 | 31,398,074,850.11 |

#### (3) 按账龄分析

| 账 龄    | 期末数               |        | 期初数               |        |
|--------|-------------------|--------|-------------------|--------|
|        | 账面余额              |        | 账面余额              |        |
|        | 金额                | 比例(%)  | 金额                | 比例(%)  |
| 1-3 个月 | 13,426,255,335.85 | 58.17  | 22,734,853,704.17 | 72.41  |
| 3-6 个月 | 4,122,520,076.95  | 17.86  | 2,790,359,795.46  | 8.89   |
| 6 个月以上 | 5,532,492,469.02  | 23.97  | 5,872,861,350.48  | 18.70  |
| 合 计    | 23,081,267,881.82 | 100.00 | 31,398,074,850.11 | 100.00 |

(4) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物情况详见本财务报表附注十二(三)之融资融券业务。

(5) 期末，融出资金中 1,361,157,813.64 元的收益权已于相关金融机构签订的转让和回购协议，公司未终止确认收益权已转让的融出资金。公司因融出资金收益权转让而取得的债务情况，详见本财务报表附注五(一)之卖出回购金融资产款。

4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 明细情况

| 项 目 | 期末数               |                                 |                   |
|-----|-------------------|---------------------------------|-------------------|
|     | 为交易目的而持有的<br>金融资产 | 指定以公允价值计量且变<br>动计入当期损益的<br>金融资产 | 合计                |
| 债券  | 24,847,427,700.10 |                                 | 24,847,427,700.10 |
| 基金  | 7,631,273,143.83  |                                 | 7,631,273,143.83  |
| 股票  | 785,209,763.18    |                                 | 785,209,763.18    |
| 其他  | 4,871,271.95      | 1,864,525,686.25                | 1,869,396,958.20  |
| 合 计 | 33,268,781,879.06 | 1,864,525,686.25                | 35,133,307,565.31 |

(续上表)

| 项 目 | 期初数               |                                 |                   |
|-----|-------------------|---------------------------------|-------------------|
|     | 为交易目的而持有的<br>金融资产 | 指定以公允价值计量且变<br>动计入当期损益的<br>金融资产 | 合计                |
| 债券  | 20,426,451,321.67 |                                 | 20,426,451,321.67 |
| 基金  | 2,048,612,112.02  |                                 | 2,048,612,112.02  |
| 股票  | 1,121,774,564.63  |                                 | 1,121,774,564.63  |
| 其他  | 50,130,982.32     | 1,372,861,165.18                | 1,422,992,147.50  |
| 合 计 | 23,646,968,980.64 | 1,372,861,165.18                | 25,019,830,145.82 |

(2) 变现有限制的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产详见本财务报表附注五(四)之所有权或使用权受到限制的资产。

5. 衍生金融资产、衍生金融负债

(1) 明细情况

| 项 目    | 期末数  |       |    |
|--------|------|-------|----|
|        | 名义金额 | 非套期工具 |    |
|        |      | 公允价值  |    |
|        |      | 资产    | 负债 |
| 权益衍生工具 |      |       |    |

| 项 目    | 期末数              |            |            |
|--------|------------------|------------|------------|
|        | 名义金额             | 非套期工具      |            |
|        |                  | 公允价值       |            |
|        |                  | 资产         | 负债         |
| 权益收益互换 | 468,213,377.68   |            | 229,947.78 |
| 股票期权合约 | 270,626,712.00   | 162,581.07 | 291,030.02 |
| 小 计    | 738,840,089.68   | 162,581.07 | 520,977.80 |
| 其他衍生工具 |                  |            |            |
| 股指期货合约 | 170,906,160.00   |            |            |
| 黄金期货合约 | 134,363,950.00   |            |            |
| 其他     | 28,100,000.00    | 276,367.25 |            |
| 小 计    | 333,370,110.00   | 276,367.25 |            |
| 合 计    | 1,072,210,199.68 | 438,948.32 | 520,977.80 |

(续上表)

| 项 目    | 期初数            |               |              |
|--------|----------------|---------------|--------------|
|        | 名义金额           | 非套期工具         |              |
|        |                | 公允价值          |              |
|        |                | 资产            | 负债           |
| 权益衍生工具 |                |               |              |
| 权益收益互换 | 305,567,579.20 | 34,552,865.00 | 4,171,508.86 |
| 股票期权合约 | 311,299,400.00 |               | 2,225,199.41 |
| 小 计    | 616,866,979.20 | 34,552,865.00 | 6,396,708.27 |
| 其他衍生工具 |                |               |              |
| 股指期货合约 | 143,341,360.00 |               |              |
| 小 计    | 143,341,360.00 |               |              |
| 合 计    | 760,208,339.20 | 34,552,865.00 | 6,396,708.27 |

(2) 期货合约

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本公司于 2016 年 12 月 31 日所有的期货合约产生的持仓损益金额。因此衍生金融工具项下的期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元，资产、负债均无余额。期末，本公司未到期的期货合约的公允价值为人民币 -1,027,130.00 元。

6. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按标的物类别

| 项 目    | 期末数               | 期初数              |
|--------|-------------------|------------------|
| 股票     | 8,835,983,673.52  | 2,975,559,235.26 |
| 债券     | 3,379,632,075.23  | 2,558,716,008.15 |
| 减：减值准备 |                   |                  |
| 合 计    | 12,215,615,748.75 | 5,534,275,243.41 |

(2) 明细情况——按业务类别

| 项 目       | 期末数               | 期初数              |
|-----------|-------------------|------------------|
| 约定购回式证券   | 104,101,000.00    | 95,652,700.00    |
| 股票质押式回购   | 8,731,882,673.52  | 2,879,906,535.26 |
| 交易所回购业务   | 780,809,000.00    | 351,400,000.00   |
| 银行间市场回购业务 | 2,598,823,075.23  | 2,207,316,008.15 |
| 合 计       | 12,215,615,748.75 | 5,534,275,243.41 |

(3) 约定购回融出资金

| 剩余期限              | 期末数            | 期初数           |
|-------------------|----------------|---------------|
| 1 个月内(含 1 个月, 下同) | 2,620,000.00   | 19,080,300.00 |
| 1 个月至 3 个月内       | 7,500,000.00   | 31,370,000.00 |
| 3 个月至 1 年内        | 93,981,000.00  | 45,202,400.00 |
| 小 计               | 104,101,000.00 | 95,652,700.00 |

(4) 股票质押回购融出资金

| 剩余期限              | 期末数              | 期初数              |
|-------------------|------------------|------------------|
| 1 个月内(含 1 个月, 下同) | 193,483,800.00   | 38,020,350.00    |
| 1 个月至 3 个月内       | 442,603,932.30   | 81,213,987.75    |
| 3 个月至 1 年内        | 3,939,124,942.62 | 1,921,580,129.63 |
| 1 年以上             | 4,156,669,998.60 | 839,092,067.88   |
| 小 计               | 8,731,882,673.52 | 2,879,906,535.26 |

(5) 担保物情况

期末公司开展约定购回业务融出资金收取的担保物公允价值 215,992,788.87 元,开展质押回购业务融出资金收取的担保物公允价值 22,598,618,273.74 元,公司开展普通证券回购业务已收取足额的担保物。

## 7. 应收款项

### (1) 类别明细情况

| 种 类      | 期末数              |        |               |        |
|----------|------------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备          |        |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 组合计提坏账准备 | 1,269,862,645.69 | 100.00 | 15,905,944.83 | 1.25   |
| 合 计      | 1,269,862,645.69 | 100.00 | 15,905,944.83 | 1.25   |

(续上表)

| 种 类      | 期初数            |        |               |        |
|----------|----------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额           |        | 坏账准备          |        |
|          | 金额             | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 组合计提坏账准备 | 390,758,000.14 | 100.00 | 15,468,601.64 | 3.96   |
| 合 计      | 390,758,000.14 | 100.00 | 15,468,601.64 | 3.96   |

### (2) 按账龄分析

| 账 龄   | 期末数              |        |               |
|-------|------------------|--------|---------------|
|       | 账面余额             |        | 坏账准备          |
|       | 金额               | 比例 (%) |               |
| 1 年以内 | 1,266,037,778.61 | 99.70  | 14,295,099.71 |
| 1-2 年 | 2,093,030.81     | 0.17   | 209,303.07    |
| 3-4 年 | 419,634.85       | 0.03   | 251,780.91    |
| 4-5 年 | 812,201.42       | 0.06   | 649,761.14    |
| 5 年以上 | 500,000.00       | 0.04   | 500,000.00    |
| 小 计   | 1,269,862,645.69 | 100.00 | 15,905,944.83 |

(续上表)

| 账 龄   | 期初数            |        |               |
|-------|----------------|--------|---------------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |
|       | 金额             | 比例 (%) |               |
| 1 年以内 | 389,026,163.87 | 99.55  | 14,397,353.82 |

| 账 龄   | 期初数            |        |               |
|-------|----------------|--------|---------------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |
|       | 金额             | 比例 (%) |               |
| 2-3 年 | 419,634.85     | 0.11   | 83,926.97     |
| 3-4 年 | 812,201.42     | 0.21   | 487,320.85    |
| 4-5 年 | 500,000.00     | 0.13   | 500,000.00    |
| 小 计   | 390,758,000.14 | 100.00 | 15,468,601.64 |

(3) 按款项性质

| 项 目       | 期末数              | 期初数            |
|-----------|------------------|----------------|
| 应收清算款项    | 435,131,372.73   | 63,764,814.14  |
| 应收期货业务保证金 | 233,155,806.28   | 158,733,045.00 |
| 应收手续费及佣金  | 175,139,521.01   | 115,969,452.66 |
| 应收融资融券款   | 386,832,965.60   | 33,586,977.99  |
| 应收资产管理费   | 12,073,152.18    | 3,972,883.75   |
| 应收基金管理费   | 23,633,151.91    | 14,412,611.56  |
| 其 他       | 3,896,675.98     | 318,215.04     |
| 合 计       | 1,269,862,645.69 | 390,758,000.14 |
| 减：坏账准备    | 15,905,944.83    | 15,468,601.64  |
| 应收款项账面价值  | 1,253,956,700.86 | 375,289,398.50 |

8. 应收利息

| 项 目    | 期末数              | 期初数              |
|--------|------------------|------------------|
| 债券投资   | 907,766,752.62   | 727,465,671.37   |
| 融资融券   | 411,816,391.40   | 531,720,996.21   |
| 存放金融同业 | 59,245,604.65    | 119,513,788.68   |
| 买入返售   | 57,863,219.77    | 61,575,065.17    |
| 其他     | 10,754,394.35    | 28,525,395.56    |
| 合 计    | 1,447,446,362.79 | 1,468,800,916.99 |

9. 存出保证金

(1) 明细情况

| 项 目   | 期末数              | 期初数              |
|-------|------------------|------------------|
| 交易保证金 | 2,389,184,210.21 | 1,978,781,649.21 |
| 信用保证金 | 40,132,607.23    | 171,299,147.38   |
| 履约保证金 | 2,000,000.00     | 328,128,595.68   |
| 合 计   | 2,431,316,817.44 | 2,478,209,392.27 |

(2) 存出保证金——外币保证金

| 项 目   | 期末数          |        |              |
|-------|--------------|--------|--------------|
|       | 原币金额         | 汇率     | 人民币金额        |
| 交易保证金 |              |        |              |
| 美元    | 470,000.00   | 6.9370 | 3,260,390.00 |
| 港币    | 3,000,000.00 | 0.8945 | 2,683,500.00 |
| 合 计   |              |        | 5,943,890.00 |

(续上表)

| 项 目   | 期初数          |        |              |
|-------|--------------|--------|--------------|
|       | 原币金额         | 汇率     | 人民币金额        |
| 交易保证金 |              |        |              |
| 美元    | 470,000.00   | 6.4936 | 3,051,992.00 |
| 港币    | 3,000,000.00 | 0.8378 | 2,513,400.00 |
| 合 计   |              |        | 5,565,392.00 |

10. 可供出售金融资产

(1) 按投资品种类别列示

1) 以公允价值计量

| 项 目      | 期末数               |                |               |                   |
|----------|-------------------|----------------|---------------|-------------------|
|          | 初始成本              | 公允价值变动         | 减值准备          | 账面价值              |
| 债券       | 11,215,902,381.14 | -51,671,118.19 | 6,645,530.00  | 11,157,585,732.95 |
| 基金       | 258,427,537.19    | 3,254,420.59   |               | 261,681,957.78    |
| 股票       | 87,177,906.80     | 8,720,297.60   | 10,816,928.96 | 85,081,275.44     |
| 证券公司理财产品 | 2,927,540,443.62  | 9,536,799.43   |               | 2,937,077,243.05  |

| 项 目    | 期末数               |                 |               |                   |
|--------|-------------------|-----------------|---------------|-------------------|
|        | 初始成本              | 公允价值变动          | 减值准备          | 账面价值              |
| 银行理财产品 | 257,000,000.00    |                 |               | 257,000,000.00    |
| 信托计划   | 1,891,233,333.33  | 929,812.86      |               | 1,892,163,146.19  |
| 其他     | 6,793,181,473.19  | -406,086,728.78 | 3,780,441.96  | 6,383,314,302.45  |
| 小 计    | 23,430,463,075.27 | -435,316,516.49 | 21,242,900.92 | 22,973,903,657.86 |

(续上表)

| 项 目      | 期初数               |                  |              |                   |
|----------|-------------------|------------------|--------------|-------------------|
|          | 初始成本              | 公允价值变动           | 减值准备         | 账面价值              |
| 债券       | 4,269,457,692.67  | 306,241,342.04   |              | 4,575,699,034.71  |
| 基金       | 119,977,813.69    | 18,504,832.50    |              | 138,482,646.19    |
| 股票       | 252,435,303.05    | 1,220,959,024.24 | 2,517,898.71 | 1,470,876,428.58  |
| 证券公司理财产品 | 196,044,540.98    | -27,792,235.48   |              | 168,252,305.50    |
| 银行理财产品   | 245,000,000.00    |                  |              | 245,000,000.00    |
| 信托计划     | 137,000,000.00    |                  |              | 137,000,000.00    |
| 其他       | 6,876,522,304.82  | -302,112,020.38  |              | 6,574,410,284.44  |
| 小 计      | 12,096,437,655.21 | 1,215,800,942.92 | 2,517,898.71 | 13,309,720,699.42 |

2) 以成本计量

| 项 目       | 期末数              |               |                  |
|-----------|------------------|---------------|------------------|
|           | 投资成本             | 减值准备          | 账面价值             |
| 非上市公司股权投资 | 3,537,751,668.86 | 28,230,386.42 | 3,509,521,282.44 |
| 小 计       | 3,537,751,668.86 | 28,230,386.42 | 3,509,521,282.44 |

(续上表)

| 项 目       | 期初数              |              |                  |
|-----------|------------------|--------------|------------------|
|           | 投资成本             | 减值准备         | 账面价值             |
| 非上市公司股权投资 | 2,854,445,534.78 | 3,290,603.42 | 2,851,154,931.36 |
| 小 计       | 2,854,445,534.78 | 3,290,603.42 | 2,851,154,931.36 |

(2) 期末按公允价值计量的可供出售金额资产

| 可供出售金融资产分类            | 可供出售<br>权益工具      | 可供出售<br>债务工具      | 小 计               |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 权益工具的成本/债务工具<br>的摊余成本 | 12,214,560,694.13 | 11,215,902,381.14 | 23,430,463,075.27 |

|                     |                   |                   |                   |
|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 公允价值                | 11,816,317,924.91 | 11,157,585,732.95 | 22,973,903,657.86 |
| 累计计入其他综合收益的公允价值变动金额 | -383,645,398.30   | -51,671,118.19    | -435,316,516.49   |
| 已计提减值金额             | 14,597,370.92     | 6,645,530.00      | 21,242,900.92     |

(3) 可供出售金融资产减值准备的变动情况

| 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     | 小 计           |
|---------------|---------------|--------------|---------------|
| 期初已计提减值金额     | 5,808,502.13  |              | 5,808,502.13  |
| 本期计提          | 37,973,604.74 | 6,645,530.00 | 44,619,134.74 |
| 其中：从其他综合收益转入  | 37,973,604.74 | 6,645,530.00 | 44,619,134.74 |
| 本期减少          | 954,349.53    |              | 954,349.53    |
| 其中：期后公允价值回升转回 |               |              |               |
| 期末已计提减值金额     | 42,827,757.34 | 6,645,530.00 | 49,473,287.34 |

(4) 期末,可供出售金融资产公允价值计量部分的其他项目包括公司对证金公司的专户投资。根据公司与证金公司签订的相关合同,公司分别于2015年7月6日和2015年9月1日出资人民币49.1677亿元和人民币17.5054亿元投入该专户。该专户由公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险和分享投资收益,由证金公司进行统一运作与投资管理。期末,公司根据证金公司提供的估值报告确定期末公允价值。

(5) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物情况以及已融出证券情况详见本财务报表附注十二(三)之融资融券业务。

(6) 变现有限制的可供出售金融资产详见本财务报表附注五(四)之所有权或使用权受到限制的资产。

11. 持有至到期投资

(1) 明细情况

| 项 目       | 期末数            | 期初数              | 期末公允价值         |
|-----------|----------------|------------------|----------------|
| 债券        | 709,272,224.56 | 1,113,911,051.55 | 733,714,294.84 |
| 其他        | 98,236,600.00  | 392,917,300.00   | 97,939,400.00  |
| 持有至到期投资合计 | 807,508,824.56 | 1,506,828,351.55 | 831,653,694.84 |

| 项 目    | 期末数            | 期初数              | 期末公允价值         |
|--------|----------------|------------------|----------------|
| 减：减值准备 |                |                  |                |
| 合 计    | 807,508,824.56 | 1,506,828,351.55 | 831,653,694.84 |

(2) 期末重要的持有至到期投资

| 项 目        | 面值             | 票面利率  | 实际利率  | 到期日         |
|------------|----------------|-------|-------|-------------|
| 10 芜湖经开债   | 100,000,000.00 | 4.95% | 5.70% | 2017年08月25日 |
| 12 芜湖经开债   | 80,000,000.00  | 6.90% | 6.81% | 2022年06月08日 |
| 13 鄂供销债    | 60,000,000.00  | 6.18% | 6.51% | 2019年10月10日 |
| 12 昆交产债 01 | 50,000,000.00  | 6.60% | 6.18% | 2017年08月17日 |
| 14 南粤银行二级  | 50,000,000.00  | 6.00% | 6.00% | 2024年12月09日 |
| 小 计        | 340,000,000.00 |       |       |             |

(3) 变现有限制的持有至到期投资详见本财务报表附注五(四)之所有权或使用权受到限制的资产。

12. 长期股权投资

(1) 分类情况

| 项 目     | 期末数           |      |               |
|---------|---------------|------|---------------|
|         | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          |
| 对联营企业投资 | 15,636,004.13 |      | 15,636,004.13 |
| 合 计     | 15,636,004.13 |      | 15,636,004.13 |

(续上表)

| 项 目     | 期初数           |      |               |
|---------|---------------|------|---------------|
|         | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          |
| 对联营企业投资 | 46,749,480.08 |      | 46,749,480.08 |
| 合 计     | 46,749,480.08 |      | 46,749,480.08 |

(2) 对联营企业投资

| 被投资单位          | 期初数           | 本期增减变动 |                |
|----------------|---------------|--------|----------------|
|                |               | 追加投资   | 权益法下确认的投资损益    |
| 北大医疗康复医院管理有限公司 | 46,749,480.08 |        | -31,113,475.95 |

|     |               |  |                |
|-----|---------------|--|----------------|
| 小 计 | 46,749,480.08 |  | -31,113,475.95 |
|-----|---------------|--|----------------|

(续上表)

| 被投资单位          | 本期增减变动      |    | 期末数           |
|----------------|-------------|----|---------------|
|                | 宣告发放现金股利或利润 | 其他 |               |
| 北大医疗康复医院管理有限公司 |             |    | 15,636,004.13 |
| 小 计            |             |    | 15,636,004.13 |

### 13. 投资性房地产

#### (1) 明细情况

| 项 目       | 房屋及建筑物         | 合 计            |
|-----------|----------------|----------------|
| 期初数       | 275,719,048.18 | 275,719,048.18 |
| 本期变动      | -55,295,763.14 | -55,295,763.14 |
| 其中:固定资产转入 | -40,537,920.00 | -40,537,920.00 |
| 其中:公允价值变动 | -14,757,843.14 | -14,757,843.14 |
| 期末数       | 220,423,285.04 | 220,423,285.04 |

(2) 投资性房地产公允价值的确定均以评估机构的评估价值作为依据。期末,投资性房地产的公允价值业经深圳市鹏信资产评估土地房地产估价有限公司、湖南盛泰房地产评估有限公司及北京卓信大华资产评估有限公司评估,并分别出具了《房地产评估报告》(鹏信咨询字〔2017〕第006号)、《房地产评估报告》(湘盛泰房评字〔2016〕第075号)以及《房地产评估报告》(卓信大华评报字〔2017〕第5004号)。

### 14. 固定资产

#### (1) 账面价值

| 项 目        | 期末数              | 期初数              |
|------------|------------------|------------------|
| 固定资产原价     | 1,376,580,403.79 | 1,274,283,966.48 |
| 减:累计折旧     | 885,291,089.41   | 801,077,139.72   |
| 固定资产减值准备   |                  |                  |
| 固定资产账面价值合计 | 491,289,314.38   | 473,206,826.76   |

(2) 固定资产增减变动表

| 项 目             | 房屋及<br>建筑物     | 机器设备          | 电子设备           | 运输设备          | 办公设备          | 其他设备          | 合 计              |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|------------------|
| 账面原值            |                |               |                |               |               |               |                  |
| 期初数             | 440,424,161.61 | 26,394,984.05 | 556,270,566.95 | 85,488,486.26 | 66,678,579.85 | 99,027,187.76 | 1,274,283,966.48 |
| 本期增加金额          | 50,009,361.00  | 54,563.00     | 82,816,062.65  | 1,243,940.25  | 13,493,600.79 | 4,238,533.43  | 151,856,061.12   |
| 1) 购置           |                | 54,563.00     | 82,816,062.65  | 1,243,940.25  | 8,798,479.11  | 4,238,533.43  | 97,151,578.44    |
| 2) 在建工程转入       |                |               |                |               | 4,695,121.68  |               | 4,695,121.68     |
| 3) 投资性房地产<br>转入 | 50,009,361.00  |               |                |               |               |               | 50,009,361.00    |
| 本期减少金额          | 75,000.00      | 2,088,815.82  | 39,397,935.88  | 1,280,473.66  | 2,680,284.26  | 4,037,114.19  | 49,559,623.81    |
| 1) 处置或报废        |                | 2,088,815.82  | 39,397,935.88  | 1,280,473.66  | 2,680,284.26  | 4,037,114.19  | 49,484,623.81    |
| 2) 转入投资性房<br>地产 | 75,000.00      |               |                |               |               |               | 75,000.00        |
| 期末数             | 490,358,522.61 | 24,360,731.23 | 599,688,693.72 | 85,451,952.85 | 77,491,896.38 | 99,228,607.00 | 1,376,580,403.79 |
| 累计折旧            |                |               |                |               |               |               |                  |
| 期初数             | 232,287,893.95 | 19,348,246.79 | 393,679,077.06 | 61,799,575.35 | 48,246,892.85 | 45,715,453.72 | 801,077,139.72   |
| 本期增加金额          | 45,345,177.65  | 1,346,810.94  | 51,007,936.70  | 7,739,129.27  | 6,661,542.77  | 16,992,907.36 | 129,093,504.69   |
| 1) 计提           | 45,345,177.65  | 1,346,810.94  | 51,007,936.70  | 7,739,129.27  | 6,661,542.77  | 16,992,907.36 | 129,093,504.69   |
| 本期减少金额          | 34,960.32      | 1,946,438.23  | 38,073,191.01  | 1,242,351.88  | 1,576,326.41  | 2,006,287.15  | 44,879,555.00    |

| 项 目             | 房屋及<br>建筑物     | 机器设备          | 电子设备           | 运输设备          | 办公设备          | 其他设备          | 合 计            |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 1) 处置或报废        |                | 1,946,438.23  | 38,073,191.01  | 1,242,351.88  | 1,576,326.41  | 2,006,287.15  | 44,844,594.68  |
| 2) 转入投资性房<br>地产 | 34,960.32      |               |                |               |               |               | 34,960.32      |
| 期末数             | 277,598,111.28 | 18,748,619.50 | 406,613,822.75 | 68,296,352.74 | 53,332,109.21 | 60,702,073.93 | 885,291,089.41 |
| 账面价值            |                |               |                |               |               |               |                |
| 期末账面价值          | 212,760,411.33 | 5,612,111.73  | 193,074,870.97 | 17,155,600.11 | 24,159,787.17 | 38,526,533.07 | 491,289,314.38 |
| 期初账面价值          | 208,136,267.66 | 7,046,737.26  | 162,591,489.89 | 23,688,910.91 | 18,431,687.00 | 53,311,734.04 | 473,206,826.76 |

(3) 未办妥产权证书的固定资产的情况

| 项 目                       | 账面原值          | 未办妥产权证书原因            |
|---------------------------|---------------|----------------------|
| 麓谷林语小区 I 区综合体 3 栋 20-23 层 | 46,997,251.00 | 预计 2017 年办妥产权证书      |
| 深圳福中路证券营业部房产              | 1,076,715.00  | 历史遗留问题, 未能办妥<br>产权证书 |
| 深圳怡景路证券营业部房产              | 1,528,800.00  |                      |
| 合 计                       | 49,602,766.00 |                      |

15. 在建工程

| 工程名称   | 期末数          |      |              |
|--------|--------------|------|--------------|
|        | 账面余额         | 减值准备 | 账面价值         |
| 营业网点建设 | 204,010.39   |      | 204,010.39   |
| 软件开发工程 | 6,907,297.27 |      | 6,907,297.27 |
| 合 计    | 7,111,307.66 |      | 7,111,307.66 |

(续上表)

| 工程名称   | 期初数           |      |               |
|--------|---------------|------|---------------|
|        | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          |
| 营业网点建设 | 201,087.53    |      | 201,087.53    |
| 软件开发工程 | 10,353,718.00 |      | 10,353,718.00 |
| 合 计    | 10,554,805.53 |      | 10,554,805.53 |

16. 无形资产

(1) 明细情况

| 项 目       | 土地使用权      | 计算机软件          | 交易席位费         | 其他           | 合 计            |
|-----------|------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 账面原值      |            |                |               |              |                |
| 期初数       | 543,267.00 | 297,499,528.27 | 73,615,496.12 | 3,518,890.00 | 375,177,181.39 |
| 本期增加金额    |            | 51,755,749.76  |               | 447,255.00   | 52,203,004.76  |
| 1) 购置     |            | 50,279,181.49  |               | 447,255.00   | 50,726,436.49  |
| 2) 在建工程转入 |            | 1,476,568.27   |               |              | 1,476,568.27   |
| 本期减少金额    |            | 535,623.36     |               |              | 535,623.36     |
| 其中：处置     |            | 535,623.36     |               |              | 535,623.36     |
| 期末数       | 543,267.00 | 348,719,654.67 | 73,615,496.12 | 3,966,145.00 | 426,844,562.79 |
| 累计摊销      |            |                |               |              |                |
| 期初数       | 378,990.04 | 176,511,254.50 | 36,427,406.06 | 418,890.00   | 213,736,540.60 |
| 本期增加金额    | 4,831.72   | 45,389,819.87  |               | 447,255.00   | 45,841,906.59  |
| 其中：计提     | 4,831.72   | 45,389,819.87  |               | 447,255.00   | 45,841,906.59  |
| 本期减少金额    |            | 236,603.11     |               |              | 236,603.11     |
| 其中：处置     |            | 236,603.11     |               |              | 236,603.11     |
| 期末数       | 383,821.76 | 221,664,471.26 | 36,427,406.06 | 866,145.00   | 259,341,844.08 |

| 项 目    | 土地使用权      | 计算机软件          | 交易席位费         | 其他           | 合 计            |
|--------|------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 减值准备   |            |                |               |              |                |
| 期初数    |            |                | 6,725,389.31  |              | 6,725,389.31   |
| 期末数    |            |                | 6,725,389.31  |              | 6,725,389.31   |
| 账面价值   |            |                |               |              |                |
| 期末账面价值 | 159,445.24 | 127,055,183.41 | 30,462,700.75 | 3,100,000.00 | 160,777,329.40 |
| 期初账面价值 | 164,276.96 | 120,988,273.77 | 30,462,700.75 | 3,100,000.00 | 154,715,251.48 |

(2) 交易席位费

| 项 目      | 期初数           | 本期增加 | 本期减少 | 期末数           |
|----------|---------------|------|------|---------------|
| 原 价:     |               |      |      |               |
| 上海交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 45,757,145.75 |      |      | 45,757,145.75 |
| B 股      | 4,024,600.41  |      |      | 4,024,600.41  |
| 深圳交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 22,033,749.96 |      |      | 22,033,749.96 |
| B 股      | 1,800,000.00  |      |      | 1,800,000.00  |
| 小 计      | 73,615,496.12 |      |      | 73,615,496.12 |
| 累 计 摊 销: |               |      |      |               |
| 上海交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 22,976,918.06 |      |      | 22,976,918.06 |
| B 股      | 2,514,976.83  |      |      | 2,514,976.83  |
| 深圳交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 10,035,511.17 |      |      | 10,035,511.17 |
| B 股      | 900,000.00    |      |      | 900,000.00    |
| 小 计      | 36,427,406.06 |      |      | 36,427,406.06 |
| 减 值 准 备: |               |      |      |               |
| 上海交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 3,205,550.14  |      |      | 3,205,550.14  |
| B 股      | 887,355.84    |      |      | 887,355.84    |
| 深圳交易所    |               |      |      |               |
| 其中: A 股  | 2,332,483.33  |      |      | 2,332,483.33  |
| B 股      | 300,000.00    |      |      | 300,000.00    |
| 小 计      | 6,725,389.31  |      |      | 6,725,389.31  |
| 账 面 价 值: |               |      |      |               |
| 上海交易所    |               |      |      |               |

| 项 目    | 期初数           | 本期增加 | 本期减少 | 期末数           |
|--------|---------------|------|------|---------------|
| 其中：A 股 | 19,574,677.55 |      |      | 19,574,677.55 |
| B 股    | 622,267.74    |      |      | 622,267.74    |
| 深圳交易所  |               |      |      |               |
| 其中：A 股 | 9,665,755.46  |      |      | 9,665,755.46  |
| B 股    | 600,000.00    |      |      | 600,000.00    |
| 合 计    | 30,462,700.75 |      |      | 30,462,700.75 |

(3) 报告期对使用寿命不确定无形资产的使用寿命进行复核的程序以及针对该项无形资产的减值测试结果的说明

经过对交易席位费及其他(主要为高尔夫会籍及期货会员资格)的使用寿命进行复核,两项资产的法定寿命和经济寿命均无法确定,亦未发现存在减值迹象。

## 17. 商誉

### (1) 商誉账面原值

| 被投资单位名称 | 期初数              | 本期增加     |        | 本期减少 | 期末数              |
|---------|------------------|----------|--------|------|------------------|
|         |                  | 本期企业合并形成 | 企业合并转入 |      |                  |
| 方正中期公司  | 224,832,662.91   |          |        |      | 224,832,662.91   |
| 民族证券公司  | 4,298,561,093.27 |          |        |      | 4,298,561,093.27 |
| 合 计     | 4,523,393,756.18 |          |        |      | 4,523,393,756.18 |

### (2) 商誉减值准备

| 形成商誉的事项          | 期初数        | 本期增加 |      | 本期减少 | 期末数        |
|------------------|------------|------|------|------|------------|
|                  |            | 计提   | 企业合并 |      |            |
| 民族证券公司并购营业部形成的商誉 | 359,581.69 |      |      |      | 359,581.69 |
| 小 计              | 359,581.69 |      |      |      | 359,581.69 |

### (3) 商誉的减值测试过程、参数及商誉减值损失确认方法

期末,公司管理层根据市场法对含有商誉的资产组进行价值测试。公司管理层估值时,主要参照可比上市公司的市净率指标,并考虑流动性折扣、控制权溢价等因素,综合运用估值方法评估含有商誉资产组的公允价值,对商誉进行减值测试。

基于上述假设和方法,公司未发现因公司并购方正中期公司以及民族证券公司而形成的商誉需要计提减值准备。

#### 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

| 项 目                          | 期末数              |                | 期初数              |                |
|------------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|
|                              | 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        |
| 坏账准备[注 1]                    | 631,663,397.29   | 157,860,838.88 | 630,458,916.47   | 157,604,470.23 |
| 可供出售金融资产公允价值变动               | 452,485,777.82   | 113,121,444.46 | 2,730,701.34     | 682,675.34     |
| 预计负债                         | 293,197,870.07   | 73,299,467.52  | 280,000,000.00   | 70,000,000.00  |
| 应付职工薪酬-工资                    | 206,804,847.55   | 51,701,211.90  | 253,327,477.34   | 63,331,869.33  |
| 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 | 200,961,593.47   | 50,240,398.36  | 2,651,137.38     | 662,784.35     |
| 固定资产折旧                       | 114,469,972.62   | 28,617,493.16  | 74,794,297.35    | 18,698,574.34  |
| 可供出售金融资产减值准备                 | 49,473,287.34    | 8,128,321.83   | 5,808,502.13     | 1,452,125.54   |
| 无形资产摊销                       | 43,033,721.07    | 10,758,430.27  | 36,597,843.43    | 9,149,460.85   |
| 可抵扣亏损                        | 20,242,949.60    | 5,060,737.40   | 22,088,324.24    | 5,522,081.06   |
| 长期应付职工薪酬                     | 19,181,900.61    | 4,795,475.15   | 13,048,187.63    | 3,262,046.91   |
| 衍生金融工具                       | 939,876.49       | 234,969.13     | 3,493,496.57     | 873,374.14     |
| 合 计                          | 2,032,455,193.93 | 503,818,788.06 | 1,324,998,883.88 | 331,239,462.09 |

[注 1]: 期末,坏账准备余额为 625,522,351.63 元,其中 4,600,000.00 元业经税务机关确认为债权损失。此外,尚有 10,742,740.66 元坏账准备已账销案存,尚未经税务机关确认债权损失。

##### (2) 未经抵销的递延所得税负债

| 项 目                  | 期末数           |              | 期初数            |               |
|----------------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
|                      | 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 | 20,488,420.60 | 5,122,105.15 | 167,442,965.09 | 41,860,741.27 |

| 项 目              | 期末数            |                | 期初数              |                |
|------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|
|                  | 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        |
| 资产               |                |                |                  |                |
| 可供出售金融资产公允价值变动   | 17,165,261.33  | 3,475,315.36   | 1,232,101,891.02 | 179,752,347.25 |
| 投资性房地产[注 2]      | 138,253,332.79 | 34,563,333.19  | 139,606,585.52   | 34,901,646.39  |
| 企业合并-固定资产及无形资产增值 | 265,285,512.75 | 66,321,378.19  | 265,285,512.75   | 66,321,378.19  |
| 合 计              | 441,192,527.47 | 109,482,131.89 | 1,804,436,954.38 | 322,836,113.10 |

[注 2]：公允价值变动影响金额为 32,868,083.69 元，自有房产转换投资性房地产计入其他综合收益金额为 87,587,858.08 元，投资性房产按税法要求进行折旧影响金额为 17,797,391.02 元。

(3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

| 项 目     | 期末数            |                 | 期初数            |                 |
|---------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
|         | 递延所得税资产和负债互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债余额 | 递延所得税资产和负债互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债余额 |
| 递延所得税资产 | 101,623,396.94 | 402,195,391.12  | 160,422,458.92 | 170,817,003.17  |
| 递延所得税负债 | 101,623,396.94 | 7,858,734.95    | 160,422,458.92 | 162,413,654.18  |

(4) 未确认递延所得税资产明细

| 项 目      | 期末数            | 期初数            |
|----------|----------------|----------------|
| 可抵扣亏损    | 138,310,751.99 | 135,629,802.26 |
| 可抵扣暂时性差异 | 6,727,084.31   | 6,725,389.31   |
| 小 计      | 145,037,836.30 | 142,355,191.57 |

(5) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

| 年 份    | 期末数            | 期初数            |
|--------|----------------|----------------|
| 2016 年 |                | 23,179,493.25  |
| 2017 年 | 33,629,863.22  | 42,309,533.30  |
| 2018 年 | 42,984,334.82  | 42,984,334.82  |
| 2019 年 | 11,254,149.11  | 11,254,149.11  |
| 2020 年 | 13,264,456.06  | 15,902,291.78  |
| 2021 年 | 37,177,948.78  |                |
| 小 计    | 138,310,751.99 | 135,629,802.26 |

19. 其他资产

(1) 明细情况

| 项 目    | 期末数              | 期初数              |
|--------|------------------|------------------|
| 预付款项   | 42,393,871.15    | 34,404,253.67    |
| 其他应收款  | 1,333,553,699.06 | 1,398,934,983.77 |
| 长期待摊费用 | 220,288,755.17   | 237,071,678.14   |
| 待摊费用   | 2,108,549.01     | 24,944,515.62    |
| 其他     | 10,949,762.22    | 70,697,404.06    |
| 合 计    | 1,609,294,636.61 | 1,766,052,835.26 |

(2) 预付款项

1) 按账龄分析

| 账 龄   | 期末数           |        | 期初数           |        |
|-------|---------------|--------|---------------|--------|
|       | 账面价值          | 比例 (%) | 账面价值          | 比例 (%) |
| 1 年以内 | 42,030,912.46 | 99.14  | 33,793,248.55 | 98.22  |
| 1-2 年 | 327,808.09    | 0.77   | 588,005.12    | 1.71   |
| 2-3 年 | 23,650.60     | 0.06   | 13,500.00     | 0.04   |
| 3 年以上 | 11,500.00     | 0.03   | 9,500.00      | 0.03   |
| 合 计   | 42,393,871.15 | 100.00 | 34,404,253.67 | 100.00 |

2) 期末，预付关联方款项情况详见本财务报表附注七(三)之关联方应收应付款项。

(3) 其他应收款

1) 类别明细情况

| 种 类      | 期末数              |        |                |        |
|----------|------------------|--------|----------------|--------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) |
| 单项计提坏账准备 | 1,789,959,736.08 | 92.12  | 570,909,736.08 | 31.90  |
| 组合计提坏账准备 | 153,210,369.78   | 7.88   | 38,706,670.72  | 25.26  |
| 合 计      | 1,943,170,105.86 | 100.00 | 609,616,406.80 | 31.37  |

(续上表)

| 种类       | 期初数              |        |                |        |
|----------|------------------|--------|----------------|--------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) |
| 单项计提坏账准备 | 1,887,123,417.48 | 93.99  | 573,073,417.48 | 30.37  |
| 组合计提坏账准备 | 120,659,140.46   | 6.01   | 35,774,156.69  | 29.65  |
| 合计       | 2,007,782,557.94 | 100.00 | 608,847,574.17 | 30.32  |

2) 按账龄分析

| 账龄    | 期末数              |        |                |
|-------|------------------|--------|----------------|
|       | 账面余额             |        | 坏账准备           |
|       | 金额               | 比例 (%) |                |
| 1 年以内 | 94,836,847.80    | 4.88   | 3,846,571.86   |
| 1-2 年 | 14,626,596.59    | 0.75   | 3,832,036.90   |
| 2-3 年 | 1,744,260,989.79 | 89.77  | 522,897,659.35 |
| 3-4 年 | 2,398,536.09     | 0.12   | 5,204,124.78   |
| 4-5 年 | 21,671,570.66    | 1.12   | 11,488,329.30  |
| 5 年以上 | 65,375,564.93    | 3.36   | 62,347,684.61  |
| 小计    | 1,943,170,105.86 | 100.00 | 609,616,406.80 |

(续上表)

| 账龄    | 期初数              |        |                |
|-------|------------------|--------|----------------|
|       | 账面余额             |        | 坏账准备           |
|       | 金额               | 比例 (%) |                |
| 1 年以内 | 68,805,858.14    | 3.42   | 1,550,574.93   |
| 1-2 年 | 1,844,872,579.73 | 91.89  | 527,734,992.73 |
| 2-3 年 | 2,525,054.72     | 0.13   | 425,991.26     |
| 3-4 年 | 22,683,427.76    | 1.13   | 13,262,959.13  |
| 4-5 年 | 1,632,424.37     | 0.08   | 1,337,723.22   |
| 5 年以上 | 67,263,213.22    | 3.35   | 64,535,332.90  |
| 小计    | 2,007,782,557.94 | 100.00 | 608,847,574.17 |

3) 其他应收款项性质分类情况

| 项目     | 期末数              | 期初数              |
|--------|------------------|------------------|
| 信托投资款项 | 1,741,500,000.00 | 1,841,500,000.00 |

|          |                  |                  |
|----------|------------------|------------------|
| 押金       | 44,091,988.65    | 49,734,191.12    |
| 保证金      | 6,770,730.90     | 23,209,707.71    |
| 预付供应商    | 54,950,835.92    | 19,249,288.37    |
| 员工借支及往来款 | 5,760,724.20     | 5,234,433.32     |
| 垫付款项及其他  | 90,095,826.19    | 68,854,937.42    |
| 小计       | 1,943,170,105.86 | 2,007,782,557.94 |
| 减：减值准备   | 609,616,406.80   | 608,847,574.17   |
| 合计       | 1,333,553,699.06 | 1,398,934,983.77 |

(4) 长期待摊费用

| 项目       | 期初数            | 本期购置增加        | 本期摊销          | 其他减少         | 期末数            |
|----------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 营业点建设及租赁 | 228,860,949.49 | 20,555,981.09 | 32,404,290.01 | 1,894,705.74 | 215,117,934.83 |
| 其他       | 8,210,728.65   | 860,626.32    | 3,900,502.40  | 32.23        | 5,170,820.34   |
| 合计       | 237,071,678.14 | 21,416,607.41 | 36,304,792.41 | 1,894,737.97 | 220,288,755.17 |

20. 资产减值准备明细

| 项目           | 期初数            | 本期计提          | 本期减少         |              | 期末数            |
|--------------|----------------|---------------|--------------|--------------|----------------|
|              |                |               | 转回           | 转销           |                |
| 坏账准备         | 624,316,175.81 | 9,124,921.33  | 5,000,000.00 | 2,918,745.51 | 625,522,351.63 |
| 可供出售金融资产减值准备 | 5,808,502.13   | 44,619,134.74 |              | 954,349.53   | 49,473,287.34  |
| 无形资产减值准备     | 6,725,389.31   |               |              |              | 6,725,389.31   |
| 商誉减值准备       | 359,581.69     |               |              |              | 359,581.69     |
| 合计           | 637,209,648.94 | 53,744,056.07 | 5,000,000.00 | 3,873,095.04 | 682,080,609.97 |

21. 应付短期融资款

(1) 明细情况

| 项目    | 期末数              | 期初数              |
|-------|------------------|------------------|
| 短期公司债 | 6,000,000,000.00 | 1,800,000,000.00 |
| 收益凭证  | 5,039,500,000.00 | 3,728,760,000.00 |

| 项 目 | 期末数               | 期初数              |
|-----|-------------------|------------------|
| 合 计 | 11,039,500,000.00 | 5,528,760,000.00 |

(2) 短期公司债

| 项 目      | 面值               | 发行日期             | 债券<br>期限<br>(天) | 发行金额             | 票面<br>利率 |
|----------|------------------|------------------|-----------------|------------------|----------|
| 15 方正 D2 | 1,800,000,000.00 | 2015 年 4 月 23 日  | 365             | 1,800,000,000.00 | 5.90%    |
| 16 方正 D1 | 6,000,000,000.00 | 2016 年 11 月 18 日 | 365             | 6,000,000,000.00 | 3.70%    |
| 小 计      | 7,800,000,000.00 |                  |                 | 7,800,000,000.00 |          |

公司于 2016 年 9 月 23 日收到《关于对方正证券股份有限公司 2016 年非公开发行证券公司短期公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函〔2016〕1839 号），根据来函通知，公司获准拟发行面值不超过 200 亿元的证券公司短期公司债券，自来函出具之日起 12 个月内组织发行。

公司 2016 年非公开发行证券公司第一期短期公司债券，发行总额为人民币 60 亿元，债券名称：16 方正 D1。本期债券发行工作已于 2016 年 11 月 18 日结束，实际发行规模 60 亿元，最终票面利率为 3.70%。

(3) 短期公司债利息支付情况

| 项 目      | 期初数 | 本期增加          | 本期减少          | 期末余额 |
|----------|-----|---------------|---------------|------|
| 15 方正 D2 |     | 32,587,397.26 | 32,587,397.26 |      |
| 小 计      |     | 32,587,397.26 | 32,587,397.26 |      |

(4) 收益凭证

| 项 目      | 期初数              | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额             |
|----------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 金添利 C 系列 | 176,270,000.00   |                  | 176,270,000.00   |                  |
| 金添利 E 系列 |                  | 47,250,000.00    | 35,850,000.00    | 11,400,000.00    |
| 金添利 D 系列 | 1,900,000,000.00 | 5,000,000,000.00 | 1,900,000,000.00 | 5,000,000,000.00 |
| 金添利 H 系列 |                  | 10,550,000.00    | 450,000.00       | 10,100,000.00    |
| 八宝饭系列    |                  | 20,000,000.00    | 2,000,000.00     | 18,000,000.00    |
| 民族民鑫收益凭证 | 943,310,000.00   |                  | 943,310,000.00   |                  |
| 民族金鑫收益凭证 | 210,500,000.00   |                  | 210,500,000.00   |                  |
| 民族安鑫收益凭证 | 498,680,000.00   |                  | 498,680,000.00   |                  |

| 项 目 | 期初数              | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额             |
|-----|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 小 计 | 3,728,760,000.00 | 5,077,800,000.00 | 3,767,060,000.00 | 5,039,500,000.00 |

期末，公司未到期收益凭证的收益率为 3.68%-6.80%。

## 22. 拆入资金

### (1) 明细情况——按金融机构

| 项 目        | 期末数 | 期初数            |
|------------|-----|----------------|
| 非银行金融机构拆入  |     | 552,000,000.00 |
| 其中：转融通融入资金 |     | 552,000,000.00 |
| 合 计        |     | 552,000,000.00 |

### (2) 转融通融入资金剩余期限

| 项 目           | 期末数 | 期初数            |
|---------------|-----|----------------|
| 1 个月以上至 3 个月内 |     | 552,000,000.00 |
| 合 计           |     | 552,000,000.00 |

## 23. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

| 项 目             | 期末数           |                           |                   |
|-----------------|---------------|---------------------------|-------------------|
|                 | 为交易目的而持有的金融负债 | 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 | 合计                |
| 结构化主体中其他投资者享有份额 |               | 10,109,466,241.68         | 10,109,466,241.68 |
| 其他              |               | 2,450.00                  | 2,450.00          |
| 合 计             |               | 10,109,468,691.68         | 10,109,468,691.68 |

(续上表)

| 项 目             | 期初数           |                           |                  |
|-----------------|---------------|---------------------------|------------------|
|                 | 为交易目的而持有的金融负债 | 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 | 合计               |
| 结构化主体中其他投资者享有份额 |               | 1,668,996,284.93          | 1,668,996,284.93 |
| 合 计             |               | 1,668,996,284.93          | 1,668,996,284.93 |

24. 卖出回购金融资产款

(1) 明细情况——按交易品种

| 项 目     | 期末数               | 期初数               |
|---------|-------------------|-------------------|
| 债券      | 17,964,037,358.39 | 12,032,429,026.55 |
| 融资融券收益权 | 1,496,000,000.00  | 9,370,000,000.00  |
| 其他      |                   | 203,000,000.00    |
| 合 计     | 19,460,037,358.39 | 21,605,429,026.55 |

(2) 明细情况——按业务类型

| 项 目       | 期末数               | 期初数               |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 债券质押式回购   | 16,999,242,522.78 | 9,324,568,573.00  |
| 债券买断式回购业务 | 360,911,835.61    | 1,761,219,453.55  |
| 报价回购业务    | 603,883,000.00    | 946,641,000.00    |
| 场外协议回购业务  | 1,496,000,000.00  | 9,573,000,000.00  |
| 合 计       | 19,460,037,358.39 | 21,605,429,026.55 |

(3) 报价回购融入资金

| 剩余期限             | 期末数            |            | 期初数            |           |
|------------------|----------------|------------|----------------|-----------|
|                  | 金额             | 利率区间       | 金额             | 利率区间      |
| 1 个月内(含 1 个月,下同) | 482,612,000.00 | 2.2%-3.45% | 854,416,000.00 | 1.7%-4.0% |
| 1 个月至 3 个月内      | 78,818,000.00  |            | 62,650,000.00  |           |
| 3 个月至 1 年内       | 42,453,000.00  |            | 29,575,000.00  |           |
| 小 计              | 603,883,000.00 |            | 946,641,000.00 |           |

(4) 担保物情况

期末债券质押式回购业务对应的债券质押的账面价值为人民币 18,343,631,620.58 元；期末报价回购业务对应质押债券的账面价值为人民币 1,153,066,301.49 元；期末质押的融资融券债权收益权金额为人民币 1,361,157,813.64 元；股票质押式回购收益权所对应的债权金额为人民币 246,000,000.00 元。

25. 代理买卖证券款

(1) 明细情况

| 项 目    | 期末数               | 期初数               |
|--------|-------------------|-------------------|
| 普通经纪业务 | 27,291,770,180.59 | 40,982,625,982.85 |
| 其中：个人  | 25,499,125,706.63 | 38,608,619,038.95 |
| 机构     | 1,792,644,473.96  | 2,374,006,943.90  |
| 信用业务   | 3,540,937,856.14  | 6,256,181,456.49  |
| 其中：个人  | 3,310,448,763.04  | 6,019,458,961.14  |
| 机构     | 230,489,093.10    | 236,722,495.35    |
| 合 计    | 30,832,708,036.73 | 47,238,807,439.34 |

(2) 代理买卖证券款——外币款项

| 币 种 | 期末数            |        |                |
|-----|----------------|--------|----------------|
|     | 原币金额           | 汇率     | 折人民币金额         |
| 美元  | 84,068,694.18  | 6.9370 | 583,184,531.52 |
| 港币  | 126,412,223.62 | 0.8945 | 113,075,734.03 |
| 小 计 |                |        | 696,260,265.55 |

(续上表)

| 币 种 | 期初数            |        |                |
|-----|----------------|--------|----------------|
|     | 原币金额           | 汇率     | 折人民币金额         |
| 美元  | 101,800,721.70 | 6.4936 | 661,053,166.44 |
| 港币  | 176,902,246.54 | 0.8378 | 148,208,702.23 |
| 小 计 |                |        | 809,261,868.67 |

26. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

| 项 目              | 期初数              | 本期增加             | 本期减少             | 期末数              |
|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 短期薪酬             | 1,921,617,440.05 | 2,585,025,805.88 | 3,367,643,343.66 | 1,138,999,902.27 |
| 离职后福利—<br>设定提存计划 | 3,668,649.77     | 145,926,916.35   | 146,167,718.82   | 3,427,847.30     |
| 合 计              | 1,925,286,089.82 | 2,730,952,722.23 | 3,513,811,062.48 | 1,142,427,749.57 |

(2) 短期薪酬明细情况

| 项 目             | 期初数              | 本期增加             | 本期减少             | 期末数              |
|-----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 工资、奖金、津贴和<br>补贴 | 1,893,020,924.32 | 2,261,793,593.79 | 3,048,744,330.23 | 1,106,070,187.88 |

| 项 目         | 期初数              | 本期增加             | 本期减少             | 期末数              |
|-------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 职工福利费       |                  | 23,972,272.71    | 23,972,272.71    |                  |
| 社会保险费       | 1,735,938.50     | 80,584,432.34    | 80,618,783.39    | 1,701,587.45     |
| 其中：医疗保险费    | 1,552,183.83     | 72,943,688.86    | 72,941,906.63    | 1,553,966.06     |
| 工伤保险费       | 79,408.07        | 2,477,610.04     | 2,500,446.33     | 56,571.78        |
| 生育保险费       | 104,346.60       | 5,163,133.44     | 5,176,430.43     | 91,049.61        |
| 住房公积金       | 755,273.12       | 90,433,910.98    | 90,346,342.94    | 842,841.16       |
| 工会经费和职工教育经费 | 26,009,178.35    | 38,479,830.34    | 45,574,846.49    | 18,914,162.20    |
| 其他          | 96,125.76        | 89,761,765.72    | 78,386,767.90    | 11,471,123.58    |
| 小 计         | 1,921,617,440.05 | 2,585,025,805.88 | 3,367,643,343.66 | 1,138,999,902.27 |

(3) 设定提存计划明细情况

| 项 目    | 期初数          | 本期增加           | 本期减少           | 期末数          |
|--------|--------------|----------------|----------------|--------------|
| 基本养老保险 | 3,474,902.44 | 138,811,460.93 | 139,014,760.28 | 3,271,603.09 |
| 失业保险费  | 193,747.33   | 7,115,455.42   | 7,152,958.54   | 156,244.21   |
| 小 计    | 3,668,649.77 | 145,926,916.35 | 146,167,718.82 | 3,427,847.30 |

27. 应交税费

| 项 目       | 期末数            | 期初数            |
|-----------|----------------|----------------|
| 代扣代缴个人所得税 | 101,267,209.87 | 30,095,302.97  |
| 企业所得税     | 48,659,032.71  | 195,940,740.57 |
| 增值税       | 40,749,833.62  | 172,824.25     |
| 城市维护建设税   | 2,544,756.25   | 5,438,303.53   |
| 教育费附加     | 1,813,754.94   | 3,868,662.51   |
| 房产税       | 245,389.63     | 103,348.38     |
| 土地使用税     | 14,959.92      | 30,436.87      |
| 印花税       | 135,529.76     | 115,602.18     |
| 营业税       |                | 78,109,824.86  |
| 其他        | 547,460.25     | 3,466,679.25   |
| 合 计       | 195,977,926.95 | 317,341,725.37 |

28. 应付款项

| 项 目           | 期末数              | 期初数              |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付货币保证金       | 6,780,989,084.68 | 5,069,287,660.47 |
| 期货风险准备金       | 123,405,641.12   | 104,797,832.12   |
| 权益类收益互换保证金    | 221,100,896.52   | 71,945,600.00    |
| 应付清算款         | 154,389,407.40   | 51,007,772.23    |
| 结构化产品应付分配款    | 28,486,235.69    | 1,376.24         |
| 应付手续费         | 9,644,616.58     | 3,475,123.67     |
| 应付现金股利款       | 4,063,525.84     | 3,703,685.50     |
| 应付客户约定购回式证券资金 | 5,205,063.68     | 5,018,846.53     |
| 应付资产及服务购置款    | 2,257,795.81     | 8,287,532.78     |
| 基金申赎往来款       | 11,698.78        | 45,688.78        |
| 期货投资者保障基金     | 949,928.57       | 1,018,976.34     |
| 其他            | 26,807,591.88    | 1,559,389.42     |
| 合计            | 7,357,311,486.55 | 5,320,149,484.08 |

29. 应付利息

| 项 目         | 期末数              | 期初数              |
|-------------|------------------|------------------|
| 应付债券        | 1,236,597,991.34 | 1,170,707,547.74 |
| 应付短期融资款     | 114,891,076.74   | 282,378,608.23   |
| 卖出回购        | 89,172,751.09    | 223,459,212.26   |
| 客户结构化产品利息支出 | 32,282,947.25    | 158,071,696.54   |
| 客户资金        | 7,843,933.34     | 13,088,858.45    |
| 拆入资金        |                  | 10,691,975.01    |
| 其中：转融通融入资金  |                  | 10,691,975.01    |
| 其他          | 7,686,136.58     |                  |
| 合 计         | 1,488,474,836.34 | 1,858,397,898.23 |

30. 预计负债

(1) 明细情况

| 项 目  | 期初数            | 本期增加          | 本期减少          | 期末数            |
|------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 未决诉讼 | 280,000,000.00 | 13,197,870.07 |               | 293,197,870.07 |
| 预提罚款 | 26,151,267.39  | 600,000.00    | 26,151,267.39 | 600,000.00     |
| 合 计  | 306,151,267.39 | 13,797,870.07 | 26,151,267.39 | 293,797,870.07 |

(2) 未决诉讼情况详见本附注十(二)之或有事项。

31. 长期应付职工薪酬

| 项 目    | 期末数           | 期初数           |
|--------|---------------|---------------|
| 其他长期福利 | 11,835,790.60 | 13,000,404.35 |
| 合 计    | 11,835,790.60 | 13,000,404.35 |

32. 应付债券

(1) 明细情况

| 项 目  | 期末数               | 期初数               |
|------|-------------------|-------------------|
| 次级债  | 31,800,000,000.00 | 28,800,000,000.00 |
| 收益凭证 | 1,700,000,000.00  | 3,161,060,000.00  |
| 合 计  | 33,500,000,000.00 | 31,961,060,000.00 |

(2) 已发行债券

| 债券名称          | 面值                | 发行日期             | 到期日期             | 票面利率  |
|---------------|-------------------|------------------|------------------|-------|
| 14 方正债        | 3,000,000,000.00  | 2014 年 4 月 28 日  | 2019 年 4 月 28 日  | 7.00% |
| 15 方正 01      | 2,800,000,000.00  | 2015 年 4 月 10 日  | 2017 年 4 月 10 日  | 6.00% |
| 15 方正 02      | 10,000,000,000.00 | 2015 年 5 月 18 日  | 2017 年 5 月 18 日  | 6.20% |
| 15 方正 03      | 10,000,000,000.00 | 2015 年 6 月 29 日  | 2017 年 6 月 29 日  | 5.60% |
| 16 方正 C1      | 10,000,000,000.00 | 2016 年 2 月 19 日  | 2021 年 2 月 19 日  | 4.43% |
| 16 方正 C2      | 3,000,000,000.00  | 2016 年 10 月 28 日 | 2019 年 10 月 28 日 | 3.80% |
| 15 民族 01 次级债券 | 3,000,000,000.00  | 2015 年 4 月 22 日  | 2017 年 4 月 22 日  | 6.50% |
| 小 计           | 41,800,000,000.00 |                  |                  |       |

(续上表)

| 债券名称          | 期初余额              | 本期增加              | 本期减少              | 期末数               |
|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 14 方正债        | 3,000,000,000.00  |                   |                   | 3,000,000,000.00  |
| 15 方正 01      | 2,800,000,000.00  |                   |                   | 2,800,000,000.00  |
| 15 方正 02      | 10,000,000,000.00 |                   |                   | 10,000,000,000.00 |
| 15 方正 03      | 10,000,000,000.00 |                   | 10,000,000,000.00 |                   |
| 16 方正 C1      |                   | 10,000,000,000.00 |                   | 10,000,000,000.00 |
| 16 方正 C2      |                   | 3,000,000,000.00  |                   | 3,000,000,000.00  |
| 15 民族 01 次级债券 | 3,000,000,000.00  |                   |                   | 3,000,000,000.00  |
| 小 计           | 28,800,000,000.00 | 13,000,000,000.00 | 10,000,000,000.00 | 31,800,000,000.00 |

根据《关于核准方正证券股份有限公司发行次级债券的批复》（证监许可〔2014〕226号），公司于2014年4月28日发行5年期面值总额为30亿元的次级债券，到期日为2019年4月28日，票面利率为7.00%，本次债券为无担保债券。

公司于2015年6月23日收到《关于对方正证券股份有限公司次级债券挂牌转让无异议的函》（上证函〔2015〕977号），发行额度为300亿，该函自出具之日起12个月内失效。

公司于2016年10月13日收到《关于对方正证券股份有限公司2016年非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》（上证函〔2016〕1917号），发行额度为300亿，该函自出具之日起12个月内失效。

公司于2015年4月10日发行了2年期面值总额为28亿元的2015年度第一期次级债券，到期日为2017年4月10日，票面利率为6.00%，债券为无担保债券。于2015年5月18日发行了2年期面值总额为100亿元的2015年度第二期次级债券，到期日为2017年5月18日，票面利率为6.20%，债券为无担保债券。于2015年6月29日发行2年期面值总额为100亿元的2015年第三期次级债券，到期日为2017年6月29日，票面利率为5.60%，本公司有权选择于第一年末赎回债券，债券为无担保债券，2016年度已赎回该债券。

公司于2016年2月19日发行了5年期面值总额为100亿元的2016年度第一期次级债券，到期日为2021年2月19日，票面利率为4.43%，本公司有权选择于第三年末赎回债券，债券为无担保债券。公司于2016年10月28日发行了3年期面值总额为30亿元的2016年度第二期次级债券，到期日为2019年10月28日，票面利率为3.8%，债券为无担保债券。

民族证券公司于 2015 年 4 月 22 日发行了面值总额为 30 亿元的 2015 年度第一期次级债券，到期日为 2017 年 4 月 22 日，票面利率为 6.5%。

(3) 已发行收益凭证

期末，公司未到期收益凭证的收益率为 4.3-6.8%，其中 200,000,000.00 元将于 1 年内到期。

33. 其他负债

(1) 明细情况

| 项 目     | 期末数            | 期初数            |
|---------|----------------|----------------|
| 应付股利    | 6,967,867.48   | 6,967,867.48   |
| 其他应付款   | 498,328,356.10 | 318,996,062.76 |
| 代理兑付债券款 | 4,537,266.60   | 4,540,374.60   |
| 预收账款    | 7,472,531.90   | 15,028,522.18  |
| 递延收益    | 184,660,314.94 | 90,760,153.90  |
| 合 计     | 701,966,337.02 | 436,292,980.92 |

(2) 应付股利

| 单位名称      | 期末数          | 期初数          |
|-----------|--------------|--------------|
| 应付本公司股东股利 | 6,967,867.48 | 6,967,867.48 |
| 合 计       | 6,967,867.48 | 6,967,867.48 |

(3) 其他应付款

| 项 目       | 期末数            | 期初数            |
|-----------|----------------|----------------|
| 信托收益权转让   | 260,000,000.00 |                |
| 证券投资者保护基金 | 76,577,853.08  | 58,320,925.68  |
| 购买商品及服务款  | 30,389,424.65  | 56,457,772.08  |
| 押金及保证金    | 6,524,278.61   | 22,537,711.81  |
| 代收代扣款     | 6,995,638.95   | 8,499,047.19   |
| 收益互换预付金   |                | 87,659,523.58  |
| 其他        | 117,841,160.81 | 85,521,082.42  |
| 合 计       | 498,328,356.10 | 318,996,062.76 |

(4) 递延收益

1) 明细情况

| 项 目  | 期末数            | 期初数           |
|------|----------------|---------------|
| 政府补助 | 184,660,314.94 | 90,760,153.90 |
| 合 计  | 184,660,314.94 | 90,760,153.90 |

2) 政府补助明细

| 项 目          | 期初余额          | 本期新增<br>补助金额  | 本期计入营业外<br>收入金额 | 期末余额           | 与资产相关/<br>与收益相关 |
|--------------|---------------|---------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 产业基金发展<br>项目 | 90,544,033.33 | 96,304,000.00 | 2,279,366.64    | 184,568,666.69 | 与资产相关           |
| 信息示范项目       | 216,120.57    |               | 124,472.32      | 91,648.25      | 与收益相关           |
| 小 计          | 90,760,153.90 | 96,304,000.00 | 2,403,838.96    | 184,660,314.94 |                 |

产业基金发展项目原系长沙市财政局根据财政支持和财政奖励条款，给予公司用于筹建办公楼及营业网点的政府补贴款。根据长沙市高新技术产业开发区管理委员会《关于科技金融工作有关问题的会议纪要》（长高新阅[2016]79号），会议决定支持公司在长沙市高新区设立产业基金，同意将财政资金用途调整为：在公司或其子公司在长沙市高新区设立或出资认购产业基金份额的情况下，将上述投资资金额等额的双控账户共管资金调整用途，置换出的双控账户资金交由公司用于设立上述基金。公司及其下属公司于2016年1月1日后已投资麓谷园区内项目的资金额度可依规视为其入股上述产业基金出资额且计入其投资麓谷项目的额度。

34. 股本

| 项 目  | 期初数              | 本期增减变动(减少以“—”表示) |    |           |    |    | 期末数              |
|------|------------------|------------------|----|-----------|----|----|------------------|
|      |                  | 发行<br>新股         | 送股 | 公积金<br>转股 | 其他 | 小计 |                  |
| 股份总数 | 8,232,101,395.00 |                  |    |           |    |    | 8,232,101,395.00 |
| 合 计  | 8,232,101,395.00 |                  |    |           |    |    | 8,232,101,395.00 |

35. 资本公积

| 项 目  | 期初数               | 本期增加 | 本期减少 | 期末数               |
|------|-------------------|------|------|-------------------|
| 股本溢价 | 16,426,028,946.43 |      |      | 16,426,028,946.43 |

|     |                   |  |  |                   |
|-----|-------------------|--|--|-------------------|
| 合 计 | 16,426,028,946.43 |  |  | 16,426,028,946.43 |
|-----|-------------------|--|--|-------------------|

36. 其他综合收益

| 项 目                                 | 期初数              | 本期发生额           |                    |                 |                   |               | 期末数             |
|-------------------------------------|------------------|-----------------|--------------------|-----------------|-------------------|---------------|-----------------|
|                                     |                  | 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                    | 1,059,258,531.38 | -151,258,293.83 | 1,494,690,847.29   | -285,315,016.74 | -1,357,342,092.88 | -3,292,031.50 | -298,083,561.50 |
| 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                    | 1,035,906,750.45 | -156,426,612.12 | 1,494,690,847.29   | -285,323,239.32 | -1,362,502,188.59 | -3,292,031.50 | -326,595,438.14 |
| 投资性房地产初始确认公允价值大于账面金额                | 21,212,092.51    | 32,890.32       |                    | 8,222.58        | 24,667.74         |               | 21,236,760.25   |
| 外币财务报表折算差额                          | 2,139,683.20     | 5,135,408.47    |                    |                 | 5,135,408.47      |               | 7,275,091.67    |
| 其他                                  | 5.22             | 19.50           |                    |                 | 19.50             |               | 24.72           |
| 其他综合收益合计                            | 1,059,258,531.38 | -151,258,293.83 | 1,494,690,847.29   | -285,315,016.74 | -1,357,342,092.88 | -3,292,031.50 | -298,083,561.50 |

37. 盈余公积

| 项 目    | 期初数            | 本期增加           | 本期减少 | 期末数              |
|--------|----------------|----------------|------|------------------|
| 法定盈余公积 | 909,954,123.09 | 205,030,880.25 |      | 1,114,985,003.34 |
| 合 计    | 909,954,123.09 | 205,030,880.25 |      | 1,114,985,003.34 |

38. 一般风险准备

| 项 目    | 期初数              | 本期增加           | 本期减少 | 期末数              |
|--------|------------------|----------------|------|------------------|
| 一般风险准备 | 1,245,485,285.55 | 260,693,229.21 |      | 1,506,178,514.76 |
| 交易风险准备 | 1,206,008,614.03 | 242,515,007.77 |      | 1,448,523,621.80 |
| 合 计    | 2,451,493,899.58 | 503,208,236.98 |      | 2,954,702,136.56 |

39. 未分配利润

(1) 明细情况

| 项 目               | 本期数              | 上年同期数            |
|-------------------|------------------|------------------|
| 期初未分配利润           | 5,879,253,822.11 | 3,187,545,894.47 |
| 加：本期归属于母公司所有者的净利润 | 2,569,336,882.57 | 4,064,211,991.64 |
| 减：提取法定盈余公积        | 205,030,880.25   | 412,056,924.14   |
| 提取一般风险准备          | 503,208,236.98   | 960,447,139.86   |
| 减：对所有者(或股东)的分配    | 740,889,125.55   |                  |
| 期末未分配利润           | 6,999,462,461.90 | 5,879,253,822.11 |

(2) 本期利润分配

公司于2016年5月20日召开的2015年年度股东大会审议通过2015年度利润分配方案：以公司截至2015年末总股本8,232,101,395股为基数，向全体股东每10股派发现金红利0.90元（含税），共计派发现金红利740,889,125.55元。公司2015年度利润分配方案已于2016年7月20日实施完毕。

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

| 项 目      | 本期数              | 上年同期数            |
|----------|------------------|------------------|
| 手续费及佣金收入 | 5,227,896,328.85 | 7,919,947,553.97 |

| 项 目                   | 本期数              | 上年同期数            |
|-----------------------|------------------|------------------|
| 证券经纪业务                | 3,894,408,745.19 | 6,976,078,566.46 |
| 其中：代理买卖证券业务           | 3,574,709,651.45 | 6,617,721,294.23 |
| 交易单元席位租赁              | 297,861,166.47   | 336,820,121.32   |
| 代销金融产品业务              | 21,837,927.27    | 21,537,150.91    |
| 期货经纪业务                | 372,017,604.54   | 315,265,890.72   |
| 投资银行业务                | 597,282,808.01   | 374,215,246.80   |
| 其中：证券承销业务             | 316,276,463.13   | 172,748,506.53   |
| 证券保荐业务                | 3,367,999.99     | 3,400,000.00     |
| 财务顾问业务                | 277,638,344.89   | 198,066,740.27   |
| 资产管理业务                | 180,947,394.47   | 100,798,782.52   |
| 基金管理业务                | 129,399,041.86   | 90,269,004.72    |
| 投资咨询业务                | 37,021,830.23    | 56,043,687.39    |
| 其他                    | 16,818,904.55    | 7,276,375.36     |
|                       |                  |                  |
| 手续费及佣金支出              | 676,749,599.02   | 404,297,960.40   |
| 证券经纪业务                | 604,266,782.63   | 391,385,222.01   |
| 其中：代理买卖证券业务           | 604,266,782.63   | 391,385,222.01   |
| 投资银行业务                | 15,455,782.03    | 10,315,136.99    |
| 其中：证券承销业务             | 8,854,809.43     | 5,970,000.00     |
| 财务顾问业务                | 6,600,972.60     | 4,345,136.99     |
| 资产管理业务                | 9,484,133.43     | 972,090.81       |
| 其他                    | 47,542,900.93    | 1,625,510.59     |
|                       |                  |                  |
| 手续费及佣金净收入             | 4,551,146,729.83 | 7,515,649,593.57 |
| 其中：财务顾问业务净收入          | 271,037,372.29   | 193,721,603.28   |
| —并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司 | 43,097,497.17    | 15,150,000.00    |
| —并购重组财务顾问业务净收入—其他     | 471,698.11       | 2,000,000.00     |
| —其他财务顾问业务净收入          | 227,468,177.01   | 176,571,603.28   |

(2) 代销金融产品业务收入

| 项 目   | 本期数                |               |
|-------|--------------------|---------------|
|       | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金及其他 | 354,222,895,653.28 | 21,837,927.27 |
| 小 计   | 354,222,895,653.28 | 21,837,927.27 |

(续上表)

| 项 目   | 上年同期数              |               |
|-------|--------------------|---------------|
|       | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金及其他 | 213,086,637,097.97 | 21,537,150.91 |
| 小 计   | 213,086,637,097.97 | 21,537,150.91 |

(3) 资产管理业务收入

| 项 目              | 集合资产管理<br>业务      | 定向资产管理<br>业务       | 专项资产管理<br>业务     |
|------------------|-------------------|--------------------|------------------|
| 期末产品数量           | 94.00             | 408.00             | 9.00             |
| 期末客户数量           | 78,267.00         | 408.00             | 61.00            |
| 其中：个人客户          | 78,015.00         | 189.00             |                  |
| 机构客户             | 252.00            | 219.00             | 61.00            |
| 期初受托资金           | 7,179,770,880.02  | 116,369,057,198.42 | 2,778,000,000.00 |
| 其中：自有资金投入        | 125,920,717.52    |                    |                  |
| 个人客户             | 4,762,822,179.87  | 20,195,408.45      |                  |
| 机构客户             | 2,291,027,982.63  | 116,348,861,789.97 | 2,778,000,000.00 |
| 期末受托资金           | 25,052,586,387.67 | 186,802,700,541.41 | 4,366,545,064.98 |
| 其中：自有资金投入        | 422,733,423.17    |                    | 95,000,000.00    |
| 个人客户             | 17,231,693,849.09 | 1,371,578,908.45   |                  |
| 机构客户             | 7,398,159,115.41  | 185,431,121,632.96 | 4,271,545,064.98 |
| 期末主要受托资产初始<br>成本 | 22,676,942,738.37 | 187,132,720,508.25 | 4,271,672,633.47 |
| 其中：股票            | 2,450,176,542.67  | 2,408,303.29       |                  |
| 基金               | 2,382,706,842.97  | 4,417,490,226.78   |                  |
| 债券               | 9,842,872,259.04  | 11,053,043,804.16  |                  |
| 资产支持证券           | 1,884,525,686.25  | 1,336,204,822.88   |                  |

| 项 目             | 集合资产管理<br>业务     | 定向资产管理<br>业务      | 专项资产管理<br>业务     |
|-----------------|------------------|-------------------|------------------|
| 股指期货(套保)        | 11,399,880.90    |                   |                  |
| 银行理财计划          | 62,000,000.00    | 24,255,120,000.00 |                  |
| 信托计划            | 478,863,384.65   | 24,795,832,933.53 |                  |
| 专项资产管理计<br>划    |                  | 1,000,000,000.00  |                  |
| 银行承兑汇票          |                  | 1,130,556,931.02  |                  |
| 资产收益权           |                  | 42,141,222,650.61 | 4,271,672,633.47 |
| 其他投资产品          | 5,564,398,141.89 | 77,000,840,835.98 |                  |
| 当期资产管理业务净收<br>入 | 80,066,239.14    | 84,267,741.82     | 7,129,280.08     |

## 2. 利息净收入

| 项 目           | 本期数              | 上年同期数            |
|---------------|------------------|------------------|
| 利息收入          | 3,503,580,694.89 | 4,381,014,208.74 |
| 存放金融同业利息收入    | 1,185,373,131.81 | 1,481,156,166.56 |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 365,303,055.29   | 368,446,016.69   |
| 客户资金存款利息收入    | 820,070,076.52   | 1,112,710,149.87 |
| 融资融券利息收入      | 1,844,446,017.53 | 2,567,271,412.89 |
| 买入返售金融资产利息收入  | 447,903,029.79   | 172,561,365.65   |
| 其中：约定购回利息收入   | 5,339,967.47     | 54,719,746.30    |
| 股权质押回购利息收入    | 375,910,583.05   | 104,758,369.11   |
| 其他            | 25,858,515.76    | 160,025,263.64   |
| 利息支出          | 3,421,854,921.50 | 3,574,202,180.81 |
| 客户资金存款利息支出    | 148,711,684.24   | 130,080,492.32   |
| 卖出回购金融资产利息支出  | 891,435,276.81   | 1,247,555,706.47 |
| 其中：报价回购利息支出   | 23,428,602.10    | 26,058,079.94    |
| 短期融资款利息支出     | 230,273,935.78   | 475,271,073.46   |
| 拆入资金利息支出      | 30,846,579.67    | 171,576,942.15   |
| 其中：转融通利息支出    | 6,931,526.96     | 149,834,336.13   |

| 项 目         | 本期数              | 上年同期数            |
|-------------|------------------|------------------|
| 应付债券利息支出    | 2,065,404,365.45 | 1,228,211,859.25 |
| 客户结构化产品利息支出 | 55,019,840.02    | 158,015,496.55   |
| 其他          | 163,239.53       | 163,490,610.61   |
|             |                  |                  |
| 利息净收入       | 81,725,773.39    | 806,812,027.93   |

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

| 项 目                     | 本期数              | 上年同期数            |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益          | -31,113,475.95   | -3,251,218.02    |
| 金融工具投资收益                | 3,616,071,552.79 | 2,299,793,086.90 |
| 其中：持有期间取得的收益            | 1,843,962,817.70 | 1,385,769,341.91 |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,219,787,947.31 | 804,602,268.43   |
| —持有至到期投资                | 55,652,986.16    | 111,258,488.74   |
| —可供出售金融资产               | 568,521,884.23   | 469,908,584.74   |
| 处置金融工具取得的收益             | 1,772,108,735.09 | 914,023,744.99   |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 269,147,404.35   | 392,469,769.54   |
| —持有至到期投资                | 21,851,420.66    | 21,394,495.97    |
| —可供出售金融资产               | 1,446,140,113.61 | 211,000,530.84   |
| —衍生金融工具                 | 34,969,796.47    | 289,158,948.64   |
| 其他                      | 2,088,885.62     | 125,663.88       |
| 合 计                     | 3,587,046,962.46 | 2,296,667,532.76 |

#### (2) 按权益法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位          | 本期数            | 上年同期数         |
|----------------|----------------|---------------|
| 北大医疗康复医院管理有限公司 | -31,113,475.95 | -3,251,218.02 |
| 合 计            | -31,113,475.95 | -3,251,218.02 |

### 4. 公允价值变动收益

| 项 目                    | 本期数             | 上年同期数          |
|------------------------|-----------------|----------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | -342,441,142.94 | 188,163,441.21 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | -119,254,698.00 | -13,893,853.61 |
| 按公允价值计量的投资性房地产         | -5,359,332.14   | 30,796,429.81  |
| 衍生金融工具                 | -32,454,596.99  | 19,721,900.16  |
| 合 计                    | -499,509,770.07 | 224,787,917.57 |

#### 5. 其他业务收入

| 项 目      | 本期数           | 上年同期数         |
|----------|---------------|---------------|
| 租赁收入     | 20,679,413.88 | 20,514,063.60 |
| 咨询服务收入   | 2,150,972.71  | 40,319,197.76 |
| 商品现货交易收入 | 4,301,923.04  |               |
| 其他       | 9,733,875.69  | 8,388,615.24  |
| 合 计      | 36,866,185.32 | 69,221,876.60 |

#### 6. 税金及附加

| 项 目     | 本期数            | 上年同期数          |
|---------|----------------|----------------|
| 营业税     | 139,452,712.78 | 596,909,929.77 |
| 城市维护建设税 | 30,898,551.02  | 41,045,704.27  |
| 教育费附加   | 22,919,166.42  | 29,067,328.88  |
| 其他[注]   | 5,307,198.86   | 1,220,077.05   |
| 合 计     | 198,577,629.08 | 668,243,039.97 |

[注]：根据财政部《增值税会计处理规定》（财会〔2016〕22号）以及《关于〈增值税会计处理规定〉有关问题的解读》，本公司将2016年5-12月房产税、车船使用税、土地使用税和印花税的发生额列报于“税金及附加”项目，2016年5月之前的发生额仍列报于“业务及管理费用”项目。

#### 7. 业务及管理费

| 项 目  | 本期数              | 上年同期数            |
|------|------------------|------------------|
| 职工薪酬 | 2,733,584,129.70 | 2,945,830,246.53 |

| 项 目       | 本期数              | 上年同期数            |
|-----------|------------------|------------------|
| 租赁及物业费    | 327,979,418.54   | 217,721,335.45   |
| 营销费用      | 228,166,177.93   | 170,660,042.68   |
| 折旧及摊销费    | 211,240,203.69   | 152,180,619.61   |
| 证券投资者保护基金 | 182,862,797.51   | 127,683,541.18   |
| 咨询费       | 105,285,355.32   | 94,095,011.28    |
| 差旅费       | 73,242,666.19    | 47,982,652.75    |
| 公杂费       | 69,756,115.62    | 62,633,361.25    |
| 邮电通讯费     | 62,912,533.46    | 55,437,525.28    |
| 其他        | 361,734,870.91   | 358,278,180.01   |
| 合 计       | 4,356,764,268.87 | 4,232,502,516.02 |

8. 资产减值损失

| 项 目          | 本期数           | 上年同期数          |
|--------------|---------------|----------------|
| 坏账损失         | 4,124,921.33  | 455,434,189.38 |
| 可供出售金融资产减值损失 | 44,619,134.74 | 1,479,160.05   |
| 合 计          | 48,744,056.07 | 456,913,349.43 |

9. 其他业务成本

| 项 目      | 本期数          | 上年同期数         |
|----------|--------------|---------------|
| 租赁支出     | 506,498.66   | 841,658.27    |
| 咨询服务费支出  | 437,910.37   | 35,689,483.33 |
| 商品现货交易成本 | 4,159,999.99 |               |
| 其他       | 80,769.45    |               |
| 合 计      | 5,185,178.47 | 36,531,141.60 |

10. 营业外收入

(1) 明细情况

| 项 目         | 本期数        | 上年同期数        | 计入本期非经常性损益的金额 |
|-------------|------------|--------------|---------------|
| 非流动资产处置利得合计 | 162,410.86 | 8,376,198.92 | 162,410.86    |

|             |               |               |               |
|-------------|---------------|---------------|---------------|
| 其中：固定资产处置利得 | 162,410.86    | 8,376,198.92  | 162,410.86    |
| 政府补助        | 56,963,487.40 | 28,234,904.27 | 56,963,487.40 |
| 其他          | 8,685,776.30  | 4,575,084.26  | 8,685,776.30  |
| 合计          | 65,811,674.56 | 41,186,187.45 | 65,811,674.56 |

(2) 政府补助说明

| 补助项目      | 本期数           | 上年同期数         | 与资产相关/<br>与收益相关 |
|-----------|---------------|---------------|-----------------|
| 财政奖励及补贴   | 54,684,120.76 | 17,479,036.40 | 与收益相关           |
| 税收返还      |               | 8,476,501.20  | 与收益相关           |
| 筹建办公楼财政补贴 | 2,279,366.64  | 2,279,366.67  | 与资产相关           |
| 小计        | 56,963,487.40 | 28,234,904.27 |                 |

11. 营业外支出

| 项目                   | 本期数           | 上年同期数          | 计入本期非经常性<br>损益的金额 |
|----------------------|---------------|----------------|-------------------|
| 非流动资产处置损失合计          | 2,966,148.68  | 1,987,482.47   | 2,966,148.68      |
| 其中：固定资产及在建工程<br>处置损失 | 2,966,148.68  | 1,899,149.09   | 2,966,148.68      |
| 对外捐赠                 | 475,000.00    | 90,000.00      | 475,000.00        |
| 未决诉讼                 | 13,197,870.07 | 79,961,119.80  | 13,197,870.07     |
| 赔款及罚款支出              | 33,577,082.91 | 28,166,579.66  | 33,577,082.91     |
| 其他                   | 4,101,863.65  | 4,316,259.81   | 4,101,863.65      |
| 合计                   | 54,317,965.31 | 114,521,441.74 | 54,317,965.31     |

12. 所得税费用

(1) 明细情况

| 项目      | 本期数             | 上年同期数            |
|---------|-----------------|------------------|
| 当期所得税费用 | 680,415,395.43  | 1,325,696,379.80 |
| 递延所得税费用 | -100,618,290.44 | 23,274,442.94    |
| 合计      | 579,797,104.99  | 1,348,970,822.74 |

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

| 项目 | 本期数 |
|----|-----|
|----|-----|

| 项 目                            | 本期数              |
|--------------------------------|------------------|
| 利润总额                           | 3,162,119,415.90 |
| 按法定/适用税率计算的所得税费用               | 790,529,853.98   |
| 子公司适用不同税率的影响                   | -181,654,309.87  |
| 调整以前期间所得税的影响                   | 1,145,076.02     |
| 非应税收入的影响                       | -83,793,740.36   |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响               | 53,154,293.28    |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响        | -2,829,376.45    |
| 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 | 6,304,547.14     |
| 其 他                            | -3,059,238.75    |
| 所得税费用                          | 579,797,104.99   |

### 13. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注合并资产负债表项目注释之其他综合收益说明。

### (三) 合并现金流量表项目注释

#### 1. 收到其他与经营活动有关的现金

| 项 目                        | 本期数              | 上年同期数            |
|----------------------------|------------------|------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债净增加额 | 8,202,838,728.79 |                  |
| 应付货币保证金现金净增加额              | 1,711,701,424.21 |                  |
| 持有至到期现金净减少额                | 780,750,594.97   | 582,614,548.32   |
| 应付信托收益权转让净增加额              | 260,000,000.00   |                  |
| 收回信托投资款                    | 100,000,000.00   |                  |
| 收回委托贷款投资                   | 70,000,000.00    |                  |
| 应付权益类互换保证金净增加额             | 61,495,772.94    |                  |
| 租赁、咨询收入                    | 60,833,261.36    | 30,009,327.58    |
| 存入交易所的保证金净额                | 46,892,574.83    | 1,196,429,203.73 |
| 收到财政奖励及补贴                  | 54,684,120.76    | 17,424,900.00    |

|             |                   |                  |
|-------------|-------------------|------------------|
| 衍生金融工具的投资收益 | 31,029,752.94     | 289,158,948.64   |
| 冻结资金        |                   | 1,772,486,058.61 |
| 收到其他与经营活动有关 | 51,404,372.34     | 39,668,760.72    |
| 合 计         | 11,431,630,603.14 | 3,927,791,747.60 |

2. 支付其他与经营活动有关的现金

| 项 目                        | 本期数               | 上年同期数            |
|----------------------------|-------------------|------------------|
| 可供出售金融资产现金净增加额             | 9,622,220,187.08  | 2,363,785,094.80 |
| 营业费用及往来                    | 1,373,623,020.41  | 809,362,403.58   |
| 应收证券清算款净增加额                | 267,984,923.42    |                  |
| 支付的投资者保护基金                 | 164,605,870.11    | 51,515,290.60    |
| 受限资金的净增加额                  | 101,883,982.38    |                  |
| 应收期货业务保证金净增加额              | 74,422,761.28     |                  |
| 罚款支出                       | 23,588,206.86     |                  |
| 赔偿支出                       | 35,499,971.80     |                  |
| 应付货币保证金现金净减少额              |                   | 1,423,490,912.55 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债净减少额 |                   | 846,911,461.79   |
| 认购银行理财                     |                   | 223,000,000.00   |
| 期货咨询劳务费                    |                   | 94,475,692.67    |
| 以现金支付的其他                   | 29,820,730.11     | 174,252,365.58   |
| 合 计                        | 11,693,649,653.45 | 5,986,793,221.57 |

3. 收到其他与投资活动有关的现金

| 项 目        | 本期数            | 上年同期数             |
|------------|----------------|-------------------|
| 存放银行的定期存款  | 800,000,000.00 |                   |
| 与资产相关的政府补助 | 96,304,000.00  |                   |
| 收购子公司现金增加额 |                | 26,811,638,633.79 |
| 合 计        | 896,304,000.00 | 26,811,638,633.79 |

4. 支付其他与投资活动有关的现金

| 项 目       | 本期数 | 上年同期数          |
|-----------|-----|----------------|
| 存放银行的定期存款 |     | 800,000,000.00 |
| 合 计       |     | 800,000,000.00 |

5. 收到其他与筹资活动有关的现金

| 项 目        | 本期数              | 上年同期数            |
|------------|------------------|------------------|
| 短期公司债及收益凭证 | 4,049,680,000.00 | 5,056,620,000.00 |
| 合 计        | 4,049,680,000.00 | 5,056,620,000.00 |

6. 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

| 补充资料                                  | 本期数                | 上年同期数              |
|---------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 1) 将净利润调节为经营活动现金流量:                   |                    |                    |
| 净利润                                   | 2,582,322,310.91   | 4,098,493,582.57   |
| 加: 资产减值准备                             | 48,744,056.07      | 456,913,349.43     |
| 固定资产折旧                                | 129,093,504.69     | 84,344,543.46      |
| 无形资产摊销                                | 45,841,906.59      | 32,520,359.83      |
| 长期待摊费用摊销                              | 36,304,792.41      | 35,315,716.32      |
| 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)      | 2,803,737.82       | -6,388,716.45      |
| 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)                   | 499,509,770.07     | -224,787,917.57    |
| 利息支出                                  | 2,295,678,301.23   | 1,703,482,932.71   |
| 汇兑损失(收益以“-”号填列)                       | -2,620,958.21      | -1,850,758.19      |
| 投资损失(收益以“-”号填列)                       | -55,116,742.05     | -90,140,986.24     |
| 递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)                  | -100,618,290.44    | -18,846,932.47     |
| 递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)                  |                    | 42,121,375.41      |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少(增加以“-”号填列) | -10,455,918,562.43 | -16,580,368,409.55 |
| 存货的减少(增加以“-”号填列)                      |                    |                    |
| 经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)                 | -10,334,201,124.70 | -8,731,596,284.02  |
| 经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)                 | -9,546,545,177.28  | 4,680,183,896.91   |

| 补充资料                  | 本期数                | 上年同期数              |
|-----------------------|--------------------|--------------------|
| 其他                    |                    | 15,763,302.60      |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -24,854,722,475.32 | -14,504,840,945.25 |
| 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               | 41,903,528,144.32  | 62,178,347,277.31  |
| 减: 现金的期初余额            | 62,178,347,277.31  | 26,999,606,883.32  |
| 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          | -20,274,819,132.99 | 35,178,740,393.99  |

(2) 现金和现金等价物的构成

| 项 目                          | 期末数               | 期初数               |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| 1) 现金                        | 41,903,528,144.32 | 62,178,347,277.31 |
| 其中: 库存现金                     | 336,664.68        | 370,186.40        |
| 可随时用于支付的银行存款                 | 31,491,328,654.75 | 46,891,099,879.00 |
| 可随时用于支付的结算备付金                | 10,401,675,865.84 | 15,255,694,188.31 |
| 可随时用于支付的其他货币资金               | 10,186,959.05     | 31,183,023.60     |
| 2) 现金等价物                     |                   |                   |
| 其中: 三个月内到期的债券投资              |                   |                   |
| 3) 期末现金及现金等价物余额              | 41,903,528,144.32 | 62,178,347,277.31 |
| 其中: 母公司或集团内子公司使用受限制的现金及现金等价物 |                   |                   |

(3) 现金流量表补充资料的说明

期末, 未作为现金及现金等价物的货币资金金额为 151,156,868.74 元, 其中母公司 143,778,745.98 元, 方正富邦公司 7,378,122.76 元。

(四) 所有权或使用权受到限制的资产

| 项 目                    | 期末账面价值            | 受限原因 |
|------------------------|-------------------|------|
| 货币资金                   | 151,156,868.74    | 1    |
| 融出资金                   | 1,361,157,813.64  | 2    |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 8,557,728,173.60  | 3    |
| 买入返售金融资产               | 246,000,000.00    | 4    |
| 可供出售金融资产               | 10,537,123,913.62 | 5    |
| 持有至到期投资                | 405,672,517.35    | 6    |
| 合 计                    | 21,258,839,286.95 |      |

1. 货币资金

| 项目或账户性质    | 限制条件或变相方面的其他重大限制 | 期末数            |
|------------|------------------|----------------|
| 共管账户       | 政府补贴             | 143,778,745.98 |
| 一般风险准备定期存款 | 基金业务一般风险准备定期存款   | 7,378,122.76   |
| 合 计        |                  | 151,156,868.74 |

2. 融出资金

| 项 目       | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数              |
|-----------|------------------|------------------|
| 融资融券债权收益权 | 场外协议回购业务质押       | 1,361,157,813.64 |
| 小 计       |                  | 1,361,157,813.64 |

3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

| 项 目 | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数              |
|-----|------------------|------------------|
| 债券  | 债券回购业务质押         | 8,406,064,491.10 |
| 债券  | 报价回购业务质押         | 148,937,000.00   |
| 股票  | 权属存在瑕疵           | 2,726,682.50     |
| 小 计 |                  | 8,557,728,173.60 |

4. 买入返售金融资产

| 项 目        | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数            |
|------------|------------------|----------------|
| 股票质押式回购收益权 | 场外协议回购业务质押       | 246,000,000.00 |
| 小 计        |                  | 246,000,000.00 |

5. 可供出售金融资产

| 项目 | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数               |
|----|------------------|-------------------|
| 债券 | 债券回购业务质押         | 9,688,636,233.62  |
| 债券 | 报价回购业务质押         | 847,387,680.00    |
| 股票 | 转融通担保证券          | 1,100,000.00      |
| 小计 |                  | 10,537,123,913.62 |

6. 持有至到期投资

| 项目 | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数            |
|----|------------------|----------------|
| 债券 | 债券回购业务质押         | 248,930,895.86 |
| 债券 | 报价回购业务质押         | 156,741,621.49 |
| 小计 |                  | 405,672,517.35 |

六、在其他主体中的权益

(一) 在重要子公司中的权益

1. 重要子公司的构成

| 子公司名称  | 主要经营地    | 注册地 | 业务性质  | 持股比例(%) |    | 取得方式       |
|--------|----------|-----|---|---------|----|------------|
|        |          |     |   | 直接      | 间接 |            |
| 瑞信方正公司 | 北京       | 北京  | 股票和债券的承销与保荐。  | 66.70   |    | 设立方式       |
| 方正中期公司 | 湖南、北京、江苏 | 北京  | 商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询；资产管理。  | 90.62   |    | 非同一控制下企业合并 |
| 方正富邦公司 | 北京       | 北京  | 基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。  | 66.70   |    | 设立方式       |
| 民族证券公司 | 北京、鞍山、乐山 | 北京  | 证券经纪、证券投资咨询、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、融资融券、证券投资基金代销；保险兼业代理；为期货公司提供中间介绍业务。 | 100.00  |    | 非同一控制下企业合并 |

2. 对于纳入合并范围的重要的结构化主体控制的依据

本公司合并的结构化主体指本公司同时作为管理人及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。

3. 重要的非全资子公司

| 子公司名称  | 少数股东持股比例 | 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     |
|--------|----------|---------------|----------------|----------------|
| 瑞信方正公司 | 33.30%   | 1,091,270.90  |                | 287,417,807.45 |
| 方正中期公司 | 9.38%    | 14,620,442.14 |                | 87,635,121.48  |
| 方正富邦公司 | 33.30%   | 1,680,268.73  |                | 99,348,814.28  |

4. 重要非全资子公司的主要财务信息

(1) 瑞信方正公司

| 项目       | 期末数/本期数         | 期初数/上年同期数      |
|----------|-----------------|----------------|
| 资产总额     | 891,961,776.25  | 889,590,232.55 |
| 负债总额     | 28,845,237.43   | 29,750,783.51  |
| 营业收入     | 179,577,923.99  | 169,559,381.34 |
| 净利润      | 3,277,089.78    | 16,238,951.73  |
| 综合收益总额   | 3,277,089.78    | 16,238,951.73  |
| 经营活动现金流量 | -598,807,686.52 | 29,451,297.49  |

(2) 方正中期公司

| 项目       | 期末数/本期数          | 期初数/上年同期数        |
|----------|------------------|------------------|
| 资产总额     | 8,136,399,693.59 | 7,090,377,994.85 |
| 负债总额     | 7,197,055,774.52 | 6,312,100,970.75 |
| 营业收入     | 551,534,775.45   | 537,162,770.10   |
| 净利润      | 156,035,823.76   | 118,835,601.59   |
| 综合收益总额   | 156,166,894.97   | 118,835,601.59   |
| 经营活动现金流量 | 190,557,222.79   | 194,388,649.39   |

(3) 方正富邦公司

| 项目       | 期末数/本期数        | 期初数/上年同期数      |
|----------|----------------|----------------|
| 资产总额     | 377,018,309.75 | 182,988,515.41 |
| 负债总额     | 78,673,522.19  | 79,766,679.03  |
| 营业收入     | 154,294,974.60 | 161,855,185.57 |
| 净利润      | 5,045,852.03   | 12,362,615.31  |
| 综合收益总额   | -4,877,048.82  | 20,792,611.41  |
| 经营活动现金流量 | 9,292,790.56   | -9,631,837.91  |

(二) 在联营企业中的权益

不重要的联营企业的汇总财务信息

| 项 目             | 期末数/本期数        | 期初数/上年同期数     |
|-----------------|----------------|---------------|
| 联营企业            |                |               |
| 投资账面价值合计        | 15,636,004.13  | 46,749,480.08 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 |                |               |
| 净利润             | -31,113,475.95 | -3,251,218.02 |
| 其他综合收益          |                |               |
| 综合收益总额          | -31,113,475.95 | -3,251,218.02 |

(三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

1. 未纳入合并财务报表范围的结构化主体

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 2016 年 12 月 31 日止，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 705,282,946.88 元。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。

2. 与权益相关资产负债的账面价值和最大损失敞口

| 项 目      | 财务报表<br>列报项目 | 期末数            |                |
|----------|--------------|----------------|----------------|
|          |              | 账面价值           | 最大损失敞口         |
| 基金       | 可供出售金融资产     | 1,210,000.00   | 1,210,000.00   |
| 证券公司理财产品 | 可供出售金融资产     | 697,572,946.88 | 697,572,946.88 |
| 其他       | 可供出售金融资产     | 6,500,000.00   | 6,500,000.00   |
| 合 计      |              | 705,282,946.88 | 705,282,946.88 |

3. 最大损失敞口的确定方法

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司因投资上述信托计划、基金、证券公司理财产品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或账面价值。

**七、关联方及关联交易**

(一) 关联方情况

1. 本公司的母公司情况

(1) 本公司的母公司

| 母公司名称 | 注册地 | 业务性质 | 注册资本<br>(万元) | 母公司对<br>本公司的 | 母公司对<br>本公司的 |
|-------|-----|------|--------------|--------------|--------------|
|-------|-----|------|--------------|--------------|--------------|

|            |     |      |            | 持股比例 (%) | 表决权比例 (%) |
|------------|-----|------|------------|----------|-----------|
| 北大方正集团有限公司 | 北京市 | 投资管理 | 110,252.86 | 27.75    | 27.75     |

(2) 本公司最终控制方是北京大学。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注在其他主体中的权益之说明。

3. 本公司的其他关联方情况

| 其他关联方名称          | 与本公司关系   |
|------------------|----------|
| 北京北大方正电子有限公司     | 受同一母公司控制 |
| 北京方正数码有限公司       | 受同一母公司控制 |
| 北京方正世纪信息系统有限公司   | 受同一母公司控制 |
| 方正国际软件有限公司       | 受同一母公司控制 |
| 方正科技集团股份有限公司     | 受同一母公司控制 |
| 北大方正人寿保险有限公司     | 受同一母公司控制 |
| 北大方正物产集团有限公司     | 受同一母公司控制 |
| 北大方正物产集团（上海）有限公司 | 受同一母公司控制 |
| 北京大学国际医院         | 受同一母公司控制 |
| 北京怡健殿诊所有限公司      | 受同一母公司控制 |
| 方正宽带网络服务有限公司     | 受同一母公司控制 |
| 方正东亚信托有限责任公司     | 其他       |
| 北京盘古氏投资有限公司      | 其他       |

(二) 关联交易情况

1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

(1) 采购商品和接受劳务的关联交易

| 关联方          | 关联交易内容 | 本期数           | 上年同期数         |
|--------------|--------|---------------|---------------|
| 北京方正数码有限公司   | 购买商品   | 25,416,481.45 | 13,666,240.00 |
| 北大方正人寿保险有限公司 | 购买保险   | 4,268,545.73  | 3,050,290.00  |
| 北京怡健殿诊所有限公司  | 接受劳务   | 626,780.00    |               |
| 北京北大方正电子有限公司 | 接受劳务   | 148,132.82    | 25,995.30     |
| 北大方正集团有限公司   | 接受劳务   | 114,188.03    | 907,938.94    |

| 关联方            | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数        |
|----------------|--------|-----|--------------|
| 方正国际软件有限公司     | 购买商品   |     | 2,148,000.00 |
| 方正东亚信托有限责任公司   | 接受劳务   |     | 1,807,877.40 |
| 北京方正世纪信息系统有限公司 | 购买商品   |     | 268,080.00   |
| 北京大学国际医院       | 接受劳务   |     | 250,504.95   |
| 方正宽带网络服务有限公司   | 购买商品   |     | 100,000.00   |
| 北京大学           | 接受劳务   |     | 64,000.00    |

(2) 出售商品和提供劳务的关联交易

| 关联方              | 关联交易内容 | 本期数           | 上年同期数     |
|------------------|--------|---------------|-----------|
| 北大方正集团有限公司       | 提供劳务   | 16,058,867.92 |           |
| 北大方正物产集团有限公司     | 提供劳务   | 25,865.82     | 11,150.21 |
| 北大方正物产集团（上海）有限公司 | 提供劳务   | 6,860.88      | 26,727.22 |

2. 关联租赁情况

| 出租方名称        | 租赁资产种类 | 本期确认的<br>租赁费  | 上年同期确认的<br>租赁费 |
|--------------|--------|---------------|----------------|
| 方正科技集团股份有限公司 | 房屋     | 2,249,568.00  | 1,796,676.00   |
| 北京盘古氏投资有限公司  | 房屋     | 72,352,278.00 | 21,437,712.00  |

3. 关于商标使用权

2011年1月31日，北大方正集团有限公司(以下简称方正集团)与本公司签署了《商标许可使用协议之补充协议》，明确了2010年12月签订的《商标许可使用协议》约定的由中文“方正”、英文“FOUNDER”和/或图形“”组合的系列“方正”商标系指注册号为776132、商品类别为36类的商标，第36类商品类别为金融证券类。相关商标由公司无偿使用。

4. 关键管理人员报酬

2016年度，本公司向高级管理人员支付的薪酬总额为9,134.56万元(上年同期数为7,908.87万元)。

(三) 关联方应收应付款项

1. 应收关联方款项

| 项目名称 | 关联方        | 期末数        |      |
|------|------------|------------|------|
|      |            | 账面余额       | 坏账准备 |
| 预付款项 | 北京方正数码有限公司 | 714,000.00 |      |

| 项目名称  | 关联方          | 期末数           |              |
|-------|--------------|---------------|--------------|
|       |              | 账面余额          | 坏账准备         |
| 其他应收款 | 北大方正人寿保险有限公司 | 619,776.00    | 30,988.80    |
| 其他应收款 | 北京盘古氏投资有限公司  | 12,000,000.00 | 9,600,000.00 |
| 小计    |              | 13,333,776.00 | 9,630,988.80 |

(续上表)

| 项目名称  | 关联方         | 期初数           |              |
|-------|-------------|---------------|--------------|
|       |             | 账面余额          | 坏账准备         |
| 其他应收款 | 北大方正集团有限公司  | 60,000.00     | 3,000.00     |
| 其他应收款 | 北京盘古氏投资有限公司 | 12,000,000.00 | 7,200,000.00 |
| 小计    |             | 12,060,000.00 | 7,203,000.00 |

## 2. 应付关联方款项

| 项目名称 | 关联方              | 期末数            | 期初数           |
|------|------------------|----------------|---------------|
| 应付款项 | 北大方正物产集团有限公司     | 129,614,486.01 | 29,446,209.87 |
|      | 北大方正物产集团(上海)有限公司 | 32,101,813.73  | 14,382,876.96 |
|      | 方正国际软件有限公司       | 273,600.00     | 273,600.00    |
|      | 北大方正集团有限公司       | 78,137.11      | 78,137.11     |
| 小计   |                  | 162,068,036.85 | 44,180,823.94 |

应付北大方正物产集团有限公司及北大方正物产集团(上海)有限公司款项均系其缴存至期货投资账户的货币保证金余额。

## 八、公允价值的披露

本公司根据以下层次确定及披露金融工具的公允价值：

第一层次：输入值是在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。

当无法从公开市场获取报价时，本公司通过一些估值技术或者询价来确定公允价值。本公司在估值技术中使用的主要参数包括标的价格、利率、汇率、波动水平、相关性及交易对手信用差价等，均为可观察到的且可从公开市场获取的参数。

### (一) 以公允价值计量的资产和负债

| 项目 | 期末公允价值     |            |            | 合计 |
|----|------------|------------|------------|----|
|    | 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 |    |
|    |            |            |            |    |

| 项 目                                  | 期末公允价值            |                |                   |                   |
|--------------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|-------------------|
|                                      | 第一层次公允<br>价值计量    | 第二层次公允<br>价值计量 | 第三层次公允<br>价值计量    | 合 计               |
| 持续的公允价值计量                            |                   |                |                   |                   |
| 资产：                                  |                   |                |                   |                   |
| 1. 以公允价值计量且变动<br>计入当期损益的金融资产         | 33,168,284,592.07 |                | 1,965,022,973.24  | 35,133,307,565.31 |
| (1) 交易性金融资产                          | 33,168,284,592.07 |                | 100,497,286.99    | 33,268,781,879.06 |
| 债务工具投资                               | 24,751,801,685.06 |                | 95,626,015.04     | 24,847,427,700.10 |
| 权益工具投资                               | 8,416,482,907.01  |                |                   | 8,416,482,907.01  |
| 其他                                   |                   |                | 4,871,271.95      | 4,871,271.95      |
| (2) 指定以公允价值计量且<br>其变动计入当期损益的金<br>融资产 |                   |                | 1,864,525,686.25  | 1,864,525,686.25  |
| 其他                                   |                   |                |                   |                   |
| 2. 衍生金融资产                            | 438,948.32        |                |                   | 438,948.32        |
| 3. 可供出售金融资产                          | 11,425,422,814.18 | 75,051,681.99  | 11,473,429,161.69 | 22,973,903,657.86 |
| (1) 债务工具投资                           | 11,153,711,262.95 |                | 3,874,470.00      | 11,157,585,732.95 |
| (2) 权益工具投资                           | 271,711,551.23    | 75,051,681.99  |                   | 346,763,233.22    |
| (3) 其他                               |                   |                | 11,469,554,691.69 | 11,469,554,691.69 |
| 持续以公允价值计量的金融<br>资产总额                 | 44,594,146,354.57 | 75,051,681.99  | 13,438,452,134.93 | 58,107,650,171.49 |
| 负债：                                  |                   |                |                   |                   |
| 1. 以公允价值计量且其变动<br>计入当期损益的金融负债”       | 10,109,468,691.68 |                |                   | 10,109,468,691.68 |
| 2. 衍生金融负债                            | 520,977.80        |                |                   | 520,977.80        |
| 持续以公允价值计量的负债<br>总额                   | 10,109,989,669.48 |                |                   | 10,109,989,669.48 |

(二) 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。

(三) 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。

国债期货合约、股指期货合约、商品期货合约及利率互换合约的公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。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来确定的。股指期货、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。2016 年，本公司上述持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

(四) 持续和非持续第三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

本公司制定了相关流程来确定持续的第三层次公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本公司定期复核相关流程以及公允价值确定的合适性。

第三层次公允价值计量的量化信息如下：

| 项 目                 | 期末公允价值            | 估值技术    | 不可观察输入值 | 对公允价值影响        |
|---------------------|-------------------|---------|---------|----------------|
| 券商理财产品、银行理财产品及信托计划等 | 13,438,452,134.93 | 现金流量折现法 | 风险调整折现率 | 风险折现率越高，公允价值越低 |

本公司采用第三层次估值的金融工具主要为以公允价值计量的券商理财产品、银行理财产品、信托计划等。2016 年，上述持续第三层次公允价值计量的资产和负债的公允价值的估值技术并未发生变更。

(五) 持续以第三层次公允价值计量项目，年初与年末账面价值间的调节信息

| 项 目                    | 期初余额             | 当期利得或损失总额      |                 | 购买                |
|------------------------|------------------|----------------|-----------------|-------------------|
|                        |                  | 计入当期损益         | 计入其他综合收益        |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,484,608,147.50 | -216,000.00    |                 | 3,266,241,894.23  |
| 其中：债券                  | 61,616,000.00    | -216,000.00    |                 |                   |
| 其他                     | 1,422,992,147.50 |                |                 | 3,266,241,894.23  |
| 可供出售金融资产               | 7,124,662,589.94 | -10,425,971.96 | -65,715,860.63  | 12,852,812,268.58 |
| 其中：债券                  |                  | -6,645,530.00  |                 | 10,520,000.00     |
| 证券公司理财产品               | 168,252,305.50   |                | 37,329,034.91   | 3,794,459,479.83  |
| 银行理财产品                 | 245,000,000.00   |                |                 | 3,625,000,000.00  |
| 信托计划                   | 137,000,000.00   |                | 929,812.86      | 2,130,900,000.00  |
| 其他                     | 6,574,410,284.44 | -3,780,441.96  | -103,974,708.40 | 3,291,932,788.75  |
| 小 计                    | 8,609,270,737.44 | -10,641,971.96 | -65,715,860.63  | 16,119,054,162.81 |

(续上表)

| 项 目 | 出售 | 结算 | 转入第三层次 | 期末余额 |
|-----|----|----|--------|------|
|-----|----|----|--------|------|

| 项 目                    | 出售 | 结算                | 转入第三层次        | 期末余额              |
|------------------------|----|-------------------|---------------|-------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |    | 2,819,837,083.53  | 34,226,015.04 | 1,965,022,973.24  |
| 其中：债券                  |    |                   | 34,226,015.04 | 95,626,015.04     |
| 其他                     |    | 2,819,837,083.53  |               | 1,869,396,958.20  |
| 可供出售金融资产               |    | 8,427,903,864.24  |               | 11,473,429,161.69 |
| 其中：债券                  |    |                   |               | 3,874,470.00      |
| 证券公司理财产品               |    | 1,062,963,577.19  |               | 2,937,077,243.05  |
| 银行理财产品                 |    | 3,613,000,000.00  |               | 257,000,000.00    |
| 信托计划                   |    | 376,666,666.67    |               | 1,892,163,146.19  |
| 其他                     |    | 3,375,273,620.38  |               | 6,383,314,302.45  |
| 小 计                    |    | 11,247,740,947.77 | 34,226,015.04 | 13,438,452,134.93 |

(六) 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

本期内各层级之间未发生转换。

(七) 本期发生的估值技术变更及变更原因

本期估值技术未发生变更。

(八) 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

公司如下金融资产和负债不以公允价值计量

|           |                    |
|-----------|--------------------|
| 金融资产：     | 88,134,872,330.78  |
| 货币资金      | 31,653,009,147.22  |
| 结算备付金     | 10,401,675,865.84  |
| 融出资金      | 23,081,267,881.82  |
| 买入返售金融资产  | 12,215,615,748.75  |
| 应收利息      | 1,447,446,362.79   |
| 应收款项      | 1,253,956,700.86   |
| 存出保证金     | 2,431,316,817.44   |
| 可供出售金融资产  | 3,509,521,282.44   |
| 持有至到期投资   | 807,508,824.56     |
| 其他应收款     | 1,333,553,699.06   |
| 金融负债：     | 104,176,360,074.11 |
| 应付短期融资款   | 11,039,500,000.00  |
| 卖出回购金融资产款 | 19,460,037,358.39  |

|         |                   |
|---------|-------------------|
| 代理买卖证券款 | 30,832,708,036.73 |
| 应付款项    | 7,357,311,486.55  |
| 应付利息    | 1,488,474,836.34  |
| 应付债券    | 33,500,000,000.00 |
| 其他应付款   | 498,328,356.10    |

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司不以公允价值计量的各项金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 九、风险管理

### (一) 风险管理政策及组织架构

#### 1. 风险管理政策

本公司使用金融工具主要目的在于作为本公司的投资运营。管理层认为，有效的风险管理对于本公司的成功投资运营至关重要。因此，本公司设计了一套风险管理与控制体系以衡量、监督和管理在经营过程中产生的风险。本公司的金融工具主要为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产以及因本公司经营直接产生的其他金融资产与负债，如应收款项、应付款项等。本公司因对金融工具的应用所产生的风险主要为信用风险、市场风险、流动性风险和操作风险等。

本公司依照《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》以及《证券公司流动性风险管理指引》等规定，建立了全面、系统的风险控制政策与程序，严格遵循规范化、计量化、系统化的原则，以实现风险的可测、可控、可承受，针对不同资产建立了审批、授权和责任承担制度，先后出台涵盖经营管理各个方面的规章制度。本公司遵照《证券公司合规管理试行规定》进行了合规管理，使合规管理覆盖了本公司所有业务、各个部门和分支机构、全体工作人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节。

本公司建立了业务风险识别、评估和控制的完整体系，运用包括敏感性分析在内的多种手段，对信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险等进行持续监控，明确风险管理流程和风险化解方法。

(1) 风险识别：辨别组织系统与业务系统中存在的风险以及关键监管指标。

(2) 风险评估：利用敏感分析、风险值等对各类风险进行定量、定性分析，分析各类风险的可能性及后果，制定风险管理战略，并通过沟通渠道进行报告。

(3) 风险控制：根据评估风险，积极采取应对措施，保证本公司的经营不受影响或将影响降至最低。

本公司根据经营环境的变化，建立动态的净资本监控机制，确保净资本符合监管指标的要求。

## 2. 风险治理组织架构

本公司的风险治理体系按分级管理模式进行：

(1) 董事会负责审批本公司风险管理基本制度、总体目标和基本政策；确定重要业务的规模及风险限额；决定重大风险的解决方案；督促、检查和评价风险管理工作等。

(2) 董事会风险控制委员会负责对本公司风险管理的基本制度、总体目标和基本政策进行审议并提出意见；监督和评价风险管理部门的设置、组织方式、工作程序和效果以及公司风险准备金的计提和使用等。

(3) 执行委员会负责执行董事会制定的风险管理政策；建立健全责任明确、程序清晰的风险管理组织架构；组织实施对各类风险的识别与评估, 决定风险应对策略, 向董事会报告风险状况。

(4) 首席风险官负责组织落实本公司全面风险管理的具体工作, 监督风险管理的政策、程序以及具体的操作规程的执行, 及时了解风险水平及其管理状况。

(5) 风险管理部协助首席风险官具体落实风险管理工作, 监测、评估、报告整体风险水平。稽核审计部对公司经营情况与财务状况进行审查与监督。

(6) 各业务及职能部门是负责全面识别、评估、应对与报告与其相关的各类风险, 针对主要风险点和风险性质, 制订业务制度和流程。

### (二) 信用风险

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约而带来损失的风险。

本公司信用风险主要来自：一是融资融券、约定购回式证券交易（以下简称约定购回）、股票质押式回购交易（以下简称股票质押回购）等信用业务客户违约给公司带来损失的风险；二是债券等金融产品投资的违约风险，即所投产品之发行人、融资人或交易对手出现违约、拒绝支付到期款项，导致资产损失和收益变化的风险；三是权益互换、场外期权等场外衍生品交易中的交易对手违约给公司带来损失的风险。

信用风险和市场风险具有一定的相关性。在市场波动的情况下，本公司在相关金融产品和交易上的信用风险敞口也会随之发生变化。因此，本公司对市场风险的一些监控和防范手段也能够对信用风险的管理发挥作用。

在融资融券、约定购回和股票质押回购业务等信用业务方面，本公司的信用风险控制主要通过对客户风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式实现。

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司信用业务的履约保障水平情况如下：

| 信用业务的履约保障水平      | 期末比例    | 期初比例    |
|------------------|---------|---------|
| 融资融券业务客户平均维持担保比例 | 264.29% | 316.89% |

|                    |         |         |
|--------------------|---------|---------|
| 约定购回业务客户平均履约保障比例   | 207.48% | 222.47% |
| 股票质押回购业务客户平均履约担保比例 | 281.64% | 414.91% |

在债券投资相关的信用风险方面，公司主要通过明确投资品种的最低等级要求、交易对手黑名单管理，并结合跟踪评估发行人或交易对手信用状况等方式和债券违约处置等方式加强债券投资业务的信用风险管理。

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司债券投资组合按照账面价值、投资评级分类的信用风险敞口如下：

货币单位：人民币万元

| 投资评级[注]                      | 期末数          | 期初数          |
|------------------------------|--------------|--------------|
| 国债、中央银行票据                    | 319,220.16   | 217,381.86   |
| 金融债券、地方政府债                   | 1,113,039.81 | 4,267.71     |
| 信用评级 AAA 级的信用债券              | 409,791.14   | 453,738.08   |
| 信用评级 AAA 级以下，BBB 级(含)以上的信用债券 | 1,768,910.48 | 1,914,722.45 |
| 信用评级 BBB 级以下的信用债券            | 57,103.10    | 19,031.94    |
| 可转换债券                        | 3,363.89     | 2,464.11     |
| 债券投资信用风险敞口合计                 | 3,671,428.58 | 2,611,606.15 |

[注]：金融债券含国家开发银行、进出口银行、农业发展银行等政策性银行发行的金融债券及国际开发机构人民币债券。信用评级以长期信用评级为基准，短期信用评级 A-1 归入 AAA 级信用债券中，短期信用评级 A-2、A-3 归入 AAA 级以下、BBB 级(含)以上的信用债券，短期信用评级 B 级(含)以下归入信用评级 BBB 级以下的信用债券。超短期融资券适用其发行主体的信用评级。未评级的信用债券归入 BBB 级以下信用债券。

在场外衍生品交易业务方面，公司主要通过投资者适当性管理、客户尽职调查、交易对手授信、标的证券折算率管理、保证金比例要求及监控、履约担保品管理和异常情形处理等多个方面加强场外衍生品交易业务信用风险控制。

由于历史原因遗留、账龄较长以及发生坏账的融出资金等存在信用风险，本公司已对单项金额重大的应收款项均全额计提了坏账准备，本公司应收款项账面金额减去相应的坏账准备代表了本公司资产负债表日应收款项信用风险敞口。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本公司的信用风险敞口为金融资产的账面价值扣除已确认的减值准备后的余额。

对于以公允价值计量的金融工具而言，其当前的风险敞口并非最大风险敞口，随公允价值的变动而变动。截至 2016 年 12 月 31 日，信用风险敞口如下：

| 金融资产类别 | 期末数 | 期初数 |
|--------|-----|-----|
|--------|-----|-----|

| 金融资产类别                 | 期末数                | 期初数                |
|------------------------|--------------------|--------------------|
| 银行存款及其他货币资金            | 31,652,672,482.54  | 47,771,555,788.96  |
| 结算备付金                  | 10,401,675,865.84  | 15,255,694,188.31  |
| 融出资金                   | 23,081,267,881.82  | 31,398,074,850.11  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 35,133,307,565.31  | 25,019,830,145.82  |
| 衍生金融资产                 | 438,948.32         | 34,552,865.00      |
| 买入返售金融资产               | 12,215,615,748.75  | 5,534,275,243.41   |
| 应收款项                   | 1,253,956,700.86   | 375,289,398.50     |
| 应收利息                   | 1,447,446,362.79   | 1,468,800,916.99   |
| 存出保证金                  | 2,431,316,817.44   | 2,478,209,392.27   |
| 可供出售金融资产               | 26,483,424,940.30  | 16,160,875,630.78  |
| 持有至到期投资                | 807,508,824.56     | 1,506,828,351.55   |
| 其他资产中的金融资产             | 1,386,897,332.43   | 1,504,036,641.50   |
| 信用风险敞口                 | 146,295,529,470.96 | 148,508,023,413.20 |

### (三) 流动风险

流动性风险，是指本公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

本公司建立了较完善的流动性风险管理体系，制定了《公司流动性风险管理办法》、《公司自有资金管理办法》、《公司资产与负债配置管理委员会工作规则》、《公司同业拆借业务管理办法》、《公司内部资金转移定价（FTP）管理办法》等，明确了流动性风险管理的偏好、制度、组织架构、职责分工、风险指标及限额、报告路线、压力测试及应急方案等。公司建立了较完善的管理信息系统或采取相应手段对流动性风险进行识别、计量、监测和控制。

本公司一贯坚持资金的统一管理和运作，明确融资管理、现金管理等由资金运营中心统一负责。2016年，为及时反映市场资金价格变动、指导业务定价、促进资金的合理高效配置、体现公司整体流动性状况及战略政策导向，本公司开始实施内部资金转移定价（FTP）。

本公司通过监测流动性覆盖率、净稳定资金率、备用金、优质流动性资产储备等指标，确保维持充裕的优质流动性资产在正常及压力情景下能够覆盖未来一定时期的现金流缺口，防范出现流动性风险。截至2016年12月31日，本公司流动性覆盖率、净稳定资金率均符合监管标准。

本公司针对流动性风险控制指标所处不同区间，以及出现日间流动性风险等情况有针对性的分别制定了流动性风险应对预案。2016 年，除根据协会统一情景开展流动性专项压力测试之外，本公司针对月度资产负债配置计划，以及子公司增资、向股东分红等开展流动性压力测试，公司根据压力测试结果优化资产负债配置。

本公司金融负债未经折现的合同现金流量到期日分析如下：

| 金融负债     | 期末数               |                  |                   |                   |       |     |                    |
|----------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------|-----|--------------------|
|          | 逾期/即时偿还           | 3 个月以内           | 3 个月到 1 年         | 1-5 年             | 5 年以上 | 无期限 | 合计                 |
| 应付短期融资款  | 5,562,969.86      | 2,043,217,435.62 | 9,347,182,876.71  | 18,100,000.00     |       |     | 11,414,063,282.19  |
| 卖出回购金融资产 | 16,317,801,778.43 | 1,896,229,995.89 | 1,375,917,959.35  |                   |       |     | 19,589,949,733.67  |
| 代理买卖证券款  | 30,832,708,036.73 |                  |                   |                   |       |     | 30,832,708,036.73  |
| 应付款项     | 7,357,311,486.55  |                  |                   |                   |       |     | 7,357,311,486.55   |
| 应付债券     |                   | 227,200,000.00   | 16,342,562,557.08 | 20,303,791,780.82 |       |     | 36,873,554,337.90  |
| 其他       | 509,833,490.18    |                  |                   |                   |       |     | 509,833,490.18     |
| 金融负债合计   | 55,023,217,761.75 | 4,166,647,431.51 | 27,065,663,393.14 | 20,321,891,780.82 |       |     | 106,577,420,367.22 |

(续上表)

| 金融负债     | 期初数               |                  |                   |                   |       |     |                    |
|----------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------|-----|--------------------|
|          | 逾期/即时偿还           | 3 个月以内           | 3 个月到 1 年         | 1-5 年             | 5 年以上 | 无期限 | 合计                 |
| 应付短期融资款  | 90,057,365.75     | 1,587,299,917.59 | 3,953,305,967.62  |                   |       |     | 5,630,663,250.96   |
| 拆入资金     |                   | 558,985,825.00   |                   |                   |       |     | 558,985,825.00     |
| 卖出回购金融资产 | 7,433,430,958.07  | 4,677,174,753.79 | 8,682,695,677.69  | 1,248,389,726.03  |       |     | 22,041,691,115.58  |
| 代理买卖证券款  | 47,238,807,439.34 |                  |                   |                   |       |     | 47,238,807,439.34  |
| 应付款项     | 5,320,149,484.08  |                  |                   |                   |       |     | 5,320,149,484.08   |
| 应付债券     |                   | 42,602,629.32    | 3,082,289,930.03  | 31,875,922,739.73 |       |     | 35,000,815,299.08  |
| 其他       | 330,504,304.84    |                  |                   |                   |       |     | 330,504,304.84     |
| 金融负债合计   | 60,412,949,552.08 | 6,866,063,125.70 | 15,718,291,575.34 | 33,124,312,465.76 |       |     | 116,121,616,718.88 |

#### (四) 市场风险

市场风险是指所持有的金融工具的公允价值因市场价格不利变动而发生的风险，包括股票、基金及衍生品等权益类证券价格风险、利率风险、汇率风险等。

本公司建立了风险限额体系，主要包括规模限额、止损限额等。董事会确定自营业务年度规模、最大可承受风险限额；执行委员会、证券投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；证券自营部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、报警线、止损线等进行前端控制；风险管理部门通过系统进行实时监控，及时进行风险提示，督促业务部门进行风险处置等。

本公司还建立了压力测试机制，分析持仓头寸在极端情景冲击下的可能损失状况，这些极端情景包括：宏观经济衰退、证券市场价格及利率大幅不利变动、特殊风险事件的发生等。压力测试是本公司市场风险管理中的重要组成部分，通过压力测试，可以更为突出地显示本公司在压力情境下的可能损失，用于衡量本公司整体的市场风险状态是否在预期范围之内。

##### 1. 利率风险

利率风险是指利率敏感性资产的公允价值因市场利率不利变动而发生损失的风险。本公司持有的具有利率敏感性的债券组合因市场利率不利变动导致公允价值变动的风险是本公司利率风险的主要来源。

本公司对债券投资组合利率风险的控制，主要采用规模和久期控制等方法，合理配置资产，并通过定期测算投资组合久期、基点价值(DV01)等指标衡量利率风险。

2016年，公司管理层根据债券市场的走势及判断，适时增加债券投资规模(按估值净价计算)，同时合理控制债券组合久期。2016年12月31日，公司债券修正久期及基点价值情况如下：

| 日期          | 持仓规模(万元)     | 修正久期(年) | 基点价值(万元) |
|-------------|--------------|---------|----------|
| 2016年12月31日 | 3,662,965.14 | 1.88    | 666.75   |
| 2015年12月31日 | 2,620,282.28 | 1.76    | 461.31   |

##### 2. 汇率风险

在汇率风险方面，本公司持有的外币资产及负债占整体的资产及负债比重并不重大；在公司收入结构中，绝大部分赚取收入的业务均以人民币进行交易。本公司外币资产及负债均为外币经纪业务，不涉及交易和投资业务。本公司通过降低外币资金的净额来降低汇率风险。

下表为汇率风险的敏感性分析,其反映了在其他变量不变的假设下,外汇汇率发生合理、可能的变动时,将对利润总额及股东权益产生的影响。

货币单位:人民币元

| 币种 | 期末数      |             |             |
|----|----------|-------------|-------------|
|    | 汇率变动     | 对利润总额的影响    | 对所有者权益的影响   |
| 美元 | +100 个基点 | 572,965.86  | 572,965.86  |
|    | -100 个基点 | -572,965.86 | -572,965.86 |
| 港币 | +100 个基点 | 542,079.88  | 542,079.88  |
|    | -100 个基点 | -542,079.88 | -542,079.88 |

(续上表)

| 币种 | 期初数      |             |             |
|----|----------|-------------|-------------|
|    | 汇率变动     | 对利润总额的影响    | 对所有者权益的影响   |
| 美元 | +100 个基点 | 284,426.97  | 284,426.97  |
|    | -100 个基点 | -284,426.97 | -284,426.97 |
| 港币 | +100 个基点 | 775,461.03  | 775,461.03  |
|    | -100 个基点 | -775,461.03 | -775,461.03 |

### 3. 权益类证券资产价格风险

权益类证券资产价格风险主要指公司所投资证券的市场价值发生变化而带来损失的风险。权益类证券资产价格风险包括自营业务投资股票、基金、衍生产品等涉及的证券价格风险。

在权益类证券投资方面,本公司采用了规模限额和止损限额等风险管理措施,根据市场情况合理控制规模和风险敞口。本公司还通过VaR等方式对正常波动情况下的短期可能损失进行衡量和分析;通过压力测试对于极端情况下的可能损失进行评估。但是,这些管理工具、方法的使用仍然受到投资策略、风险对冲策略有效性的影响。此外,管理工具、方法的有效性在市场流动性发生负面变化也会受到制约。

本公司根据历史数据计算权益类证券的VaR(置信水平为95%,持有期为1个交易日)。虽然VaR分析是衡量市场风险的重要工具,但VaR模型主要依赖历史数据信息,因此存在一定限制,不一定能准确预测风险因素未来的变化,特别是难以反映市场最极端情况下的风险。本公司2016年12月31日权益类证券持仓的VaR值为0.93亿元。

本公司的价格风险敞口如下:

| 项 目                    | 期末数               |            | 期初数               |            |
|------------------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
|                        | 公允价值              | 占净资产比例 (%) | 公允价值              | 占净资产比例 (%) |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 35,133,307,565.31 | 97.06      | 25,019,830,145.82 | 70.43      |
| 其中：债券                  | 24,847,427,700.10 | 68.65      | 20,426,451,321.67 | 57.50      |
| 基金                     | 7,631,273,143.83  | 21.08      | 2,048,612,112.02  | 5.77       |
| 股票                     | 785,209,763.18    | 2.17       | 1,121,774,564.63  | 3.16       |
| 其他                     | 1,869,396,958.20  | 5.16       | 1,422,992,147.50  | 4.01       |
| 可供出售金融资产               | 22,973,903,657.86 | 63.47      | 13,309,720,699.42 | 37.47      |
| 其中：债券                  | 11,157,585,732.95 | 30.82      | 4,575,699,034.71  | 12.88      |
| 基金                     | 261,681,957.78    | 0.72       | 138,482,646.19    | 0.39       |
| 股票                     | 85,081,275.44     | 0.24       | 1,470,876,428.58  | 4.14       |
| 证券公司理财产品               | 2,937,077,243.05  | 8.11       | 168,252,305.50    | 0.47       |
| 银行理财产品                 | 257,000,000.00    | 0.71       | 245,000,000.00    | 0.69       |
| 信托计划                   | 1,892,163,146.19  | 5.23       | 137,000,000.00    | 0.39       |
| 其他                     | 6,383,314,302.45  | 17.64      | 6,574,410,284.44  | 18.51      |
| 合计                     | 58,107,211,223.17 | 160.53     | 38,329,550,845.24 | 107.90     |

截至2016年12月31日，若本公司持有的上述投资的公允价值上升5%且其他市场变量保持不变，本公司净资产将相应增加8.03%(2015年：5.39%)；反之，若本公司持有金融工具的公允价值下降5%且其他市场变量保持不变，本公司净资产则将相应下降8.03%(2015年：5.39%)。

#### (五) 操作风险

操作风险通常包括因内部人为操作失误、内部流程不完善、信息系统故障或不完善等原因而导致的风险，也包括外部发生欺诈行为给本公司造成损失的风险。尽管本公司根据中国证监会《证券公司内部控制指引》等的规定，制定了较为完善的内部控制制度，但仍不能保证完全避免因操作差错和主观不作为可能带来的经济损失、法律纠纷和违规风险。

信息技术风险是目前操作风险的一个主要组成部分，信息技术对于证券交易、清算和服务等多个方面的业务发展和管理至关重要，系统不可靠、网络技术不完善、数据误差都会造成本公司的损失。此外，本公司所处的证券行业是一个智力密集型行业，员工道德风险相对其他行业来说更加突出，员工发生道德犯罪，将会给公司资产造成损失，对声誉造成不利影

响。本公司将坚持不断健全内部控制管理机制，完善操作流程，强化问责制，加强职业操守和职业道德教育，减少操作风险发生的可能性及其不利影响。

## 十、承诺及或有事项

### (一) 重要承诺事项

已签订的正在或准备履行的租赁合同及财务影响

公司以后年度将支付的不可撤销最低租赁付款额如下：

| 剩余租赁期 | 金 额            |
|-------|----------------|
| 1 年以内 | 234,927,981.88 |
| 1-2 年 | 196,329,200.80 |
| 2-3 年 | 125,826,873.81 |
| 3 年以上 | 227,878,752.65 |
| 小 计   | 784,962,809.14 |

### (二) 或有事项

#### 1. 火箭债权纠纷案

2001 年 1 月，公司原湖南证券有限责任公司(后更名为泰阳证券有限责任公司，以下简称泰阳证券)与航天固体运载火箭有限公司(以下简称火箭公司)签订《资产委托管理协议》及《资产委托管理补充协议》，约定火箭公司委托湖南证券管理现金资产 2 亿元，约定年收益为 15%。2007 年 9 月 29 日火箭公司向泰阳证券发出《关于归还委托理财金的函》，要求泰阳证券在 2007 年 12 月 31 日前归还 2.3 亿元资金。2007 年 12 月 24 日，火箭公司向湖南省高院以委托理财纠纷为由起诉泰阳证券，要求归还委托理财本息。2008 年 3 月 25 日，湖南省高级人民法院以“由于本案与原告总经理陈军及被告原总裁李选民等人涉嫌操纵证券交易价格罪有关联”作出(2008)湘高法民二初字第 2-1 号民事裁定书，依法裁定中止审理该案。

2012 年 3 月 14 日，湖南省高级人民法院作出书面通知，通知该案已移送湖南省公安厅经济犯罪侦查总队处理，至此该民事案的诉讼已终结。

2013 年 7 月，航天科工资产管理有限公司(以下简称航天资管公司)以与火箭公司签订《债权转让协议》且在协议生效 60 日内未能收回债权为由，向北京市第一中级人民法院起诉火箭公司，并于 2013 年 8 月向北京市第一中级人民法院申请追加我公司为第一被告，请求判决本公司向申请人偿还 238,885,700 元，及 2 亿元本金自 2002 年 1 月 10 日起的同期银行贷款利息(五年同期贷款利率 5.76%)，暂计至 2012 年 10 月 31 日为 124,480,000 元，第二被

告火箭公司对上述债务承担连带保证责任。公司在一审提交答辩期间贵管辖权提出异议，主张：一、本案所涉纠纷不属于法院民事案件管辖范围；二、本案应依据《资产委托管理协议》确定的主法律关系确定管辖法院。2013 年 9 月 16 日北京市第一中级人民法院作出民事裁定(2013)一中民初字第 10390 号，裁定：驳回方正证券公司对本案管辖权提出的异议。

公司不服上述民事裁定，上诉至北京市高级人民法院，北京市高级人民法院于 2014 年 1 月 14 日作出民事裁定(2013)高民终字第 4353 号，认为管辖权的确定是人民法院根据当事人的诉请和答辩，就案件管辖权的事实依据和法律依据的一种司法活动，裁定：驳回上诉，维持原裁定。而后公司向中华人民共和国最高人民法院申请再审，由中华人民共和国最高人民法院作出撤销北京市第一中级人民法院(2013)一中民初字第 10390 号以及北京市高级人民法院(2013)高民终字第 4353 号民事裁定，本案由北京市高级人民法院作为一审法院进行审理。

2015 年 8 月，公司依法向最高人民法院提起上诉，最高院依法组成合议庭，于 2015 年 12 月 2 日开庭审理本案，2016 年 5 月 5 日组织双方当事人进行调解，但未达成一致，截至本财务报表报出日仍未下达二审判决。参考北京市立方律师事务所对此案件的诉讼结果可能性及影响的评估和判断，截至 2016 年 12 月 31 日公司已对该项诉讼计提了 2.8 亿元的预计负债。

## 2. 东营中拓债权纠纷案

2007 年 5 月 11 日，泰阳证券与东营中拓投资有限责任公司（以下简称东营中拓公司）签订《协议书》。《协议书》约定由东营中拓公司代替其股东向泰阳证券支付股权转让款及利息。协议签订后，东营中拓公司将 13,016,711.05 元资产转移至泰阳证券指定账户内。2013 年，公司以东营中拓公司未履行《协议书》约定剩余义务抛售相关股票致使公司无法收回该部分资产为由提起诉讼，山东省东营市中级人民法院判决东营中拓公司向公司赔偿损失 4,487,767.25 元。东营中拓公司不服原审判决上诉至山东省高级人民法院起诉，2015 年 12 月 4 日山东省高级人民法院作出(2015)鲁商终字第 255 号民事判决书，认为 2007 年 5 月 11 日泰阳证券与东营中拓公司签订的《协议书》无效。

2016 年 3 月 3 日，东营中拓公司以山东省高级人民法院民事判决书已确认“2007 年 5 月 11 日泰阳证券与东营中拓签订的《协议书》无效”为由，向长沙天心区人民法院提起诉讼，请求法院判令公司返还基于前述《协议书》取得的款项 13,016,711.05 元，并承担本案诉讼费用。2017 年 3 月 15 日，公司收到长沙天心区人民法院一审判决：限公司在判决书生

效之日起 15 日内向原告东营中拓公司返还款项 13,016,711.05 元。

截至本财务报表报出日，公司已向湖南省长沙市中级人民法院递交上诉状，暂未收到开庭通知。

### 3. 中国农业银行辽宁省分行诉民族证券公司合同纠纷

2000 年 5 月，中国农业银行辽宁省分行因与中国民族国际信托投资公司（以下简称中国民族信托）拆借合同纠纷诉至沈阳市沈河区人民法院，双方达成调解，由中国民族信托偿还农行 380 万美元及相应利息，但中国民族信托一直未能偿还。2003 年 11 月 27 日，沈阳市沈河区法院做出（2001）沈河执字第 1237 号《民事裁定书》，裁定由民族证券公司偿还中国民族信托所欠农行辽宁省分行债务。

2013 年 4 月 19 日，沈阳市沈河区法院根据《最高人民法院关于审理与企业改制相关的民事纠纷案件若干问题的规定》第七条“企业以其优质财产与他人组建新公司，而将债务留在原企业，债权人以新设公司和原企业作为共同被告起诉诉讼主张债权的，新设公司应当在所接收的财产范围内与原企业共同承担连带责任”的规定，做出（2001）沈河执字第 1237 号-3《民事裁定书》，裁定：一、撤销 2003 年 11 月 27 日的（2001）沈河执字第 1237 号《民事裁定书》；二、追加民族证券公司为被执行人，在民族证券公司接受财产范围内就被执行人中国民族信托未清偿的债务向农行辽宁省分行进行清偿。

经民族证券公司提出执行异议，沈阳市沈河区法院于 2013 年 9 月 30 日做出裁定撤销沈河区法院做出（2001）沈河执字第 1237 号-3《民事裁定书》的第二项内容，农行辽宁省分行不服该裁定向沈阳市中院申请复议，沈阳市中院于 2014 年 7 月 9 日裁定驳回复议。”

2016 年 9 月 8 日，公司收到辽宁省高级人民法院送达的起诉状，辽宁省分行以中国民族信托执行程序中不履行义务，转移其优质资产于 2001 年以其证券营业部和证券资产出资，与他人共同设立民族证券公司，符合《最高人民法院关于审理与企业改制相关的民事纠纷案件若干问题的规定》第七条的规定为由。将民族证券公司作为被告，中国民族信托为第三人，向法院起诉要求公司支付本息共计 14,071.76 万元（其中本金 2,572.76 万元，利息 11,499.00 万元），以及承担诉讼费 15 万元。

本案于 2016 年 12 月 7 日第一次开庭，庭审结束后，公司向辽宁省高级人民法院提交了调取案件相关证据的申请，2017 年 2 月 7 日法院组织进行了本案第二次开庭，目前尚未判决。截至 2016 年 12 月 31 日，公司根据已掌握的情况认为具有对抗辽宁省分行诉讼主张的事实及法律依据，从法理的角度而言相对乐观。但考虑到本案历时较长及历史股权变更等客

观情况，本案仍存在一定的诉讼风险，具有不确定性。

## 十一、资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本公司不存在需要披露的重要资产负债表日后事项。

## 十二、其他重要事项

### (一) 分部信息

#### 1. 本公司确定报告分部考虑的因素

公司以内部组织结构、管理要求等为依据确定经营分部，并以经营分部为基础确定报告分部。分别对经纪及信用交易业务、自营投资业务、资产管理业务、投资银行业务等的经营业绩进行考核。

#### 2. 各报告分部利润(亏损)、资产及负债信息

| 项 目          | 本期数               |                   |                |                  |                   |                    |                    |
|--------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
|              | 经纪及信用交易           | 自营投资              | 资产管理           | 投资银行             | 总部及其他             | 抵销                 | 合计                 |
| (1) 营业收入     | 6,279,156,094.44  | 1,095,192,066.70  | 200,461,892.98 | 591,045,320.44   | 745,024,786.27    | -1,150,983,321.69  | 7,759,896,839.14   |
| 其中：手续费及佣金净收入 | 3,324,770,108.45  | -3,494,606.56     | 217,249,053.78 | 563,234,169.01   | 547,809,710.15    | -98,421,705.00     | 4,551,146,729.83   |
| 利息净收入        | 2,894,843,963.01  | -391,845,782.44   | 32,489.24      | 17,958,380.85    | -2,451,338,748.97 | 12,075,471.70      | 81,725,773.39      |
| 投资收益         | 32,699,096.28     | 1,829,709,370.44  | -16,819,650.04 | 26,482,816.87    | 2,773,205,282.30  | -1,058,229,953.39  | 3,587,046,962.46   |
| 公允价值变动       | 1,119,835.91      | -343,816,526.40   |                | -21,377,487.22   | -135,435,592.36   |                    | -499,509,770.07    |
| (2) 营业支出     | 2,180,381,458.08  | 137,452,987.32    | 65,518,477.06  | 400,018,542.84   | 1,918,531,508.38  | -92,631,841.19     | 4,609,271,132.49   |
| (3) 营业利润(亏损) | 4,098,774,636.36  | 957,739,079.38    | 134,943,415.92 | 191,026,777.60   | -1,173,506,722.11 | -1,058,351,480.50  | 3,150,625,706.65   |
| (4) 资产总额     | 59,491,432,931.74 | 21,926,974,584.12 | 288,774,767.87 | 1,081,733,293.05 | 84,487,772,419.58 | -14,937,957,750.32 | 152,338,730,246.04 |
| (5) 负债总额     | 38,395,118,329.11 | 16,787,933,940.30 | 12,180,675.46  | 39,898,476.14    | 62,254,206,283.86 | -1,347,451,908.22  | 116,141,885,796.65 |
| (6) 补充信息     |                   |                   |                |                  |                   |                    |                    |
| 1) 折旧和摊销费用   | 70,856,750.47     | 7,076,262.01      | 316,166.39     | 3,162,234.80     | 129,828,790.02    |                    | 211,240,203.69     |
| 2) 资本性支出     | 59,808,095.54     | 2,920,120.67      | 389,431.93     | 7,570,095.50     | 100,240,313.31    |                    | 170,928,056.95     |
| 3) 资产减值损失    | 3,484,810.27      | 11,482,530.63     | 2,244,531.23   | 17,600.00        | 31,514,583.94     |                    | 48,744,056.07      |

(续上表)

| 项 目          | 上年同期数             |                   |                |                  |                   |                    |                    |
|--------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
|              | 经纪及信用交易           | 自营投资              | 资产管理           | 投资银行             | 总部及其他             | 抵销                 | 合计                 |
| (1) 营业收入     | 9,374,809,033.83  | 1,690,015,112.35  | 116,058,969.47 | 418,604,947.88   | -565,752,616.34   | -118,745,740.57    | 10,914,989,706.62  |
| 其中：手续费及佣金净收入 | 6,550,931,072.75  | -895,709.41       | 115,175,880.35 | 339,174,244.87   | 555,813,956.05    | -44,549,851.04     | 7,515,649,593.57   |
| 利息净收入        | 2,764,770,621.57  | -234,506,526.54   | 326,337.93     | 39,883,932.57    | -1,764,341,246.63 | 678,909.03         | 806,812,027.93     |
| 投资收益         | 24,689,292.86     | 1,735,248,471.86  | 556,751.19     | 33,878,083.93    | 575,181,680.28    | -72,886,747.36     | 2,296,667,532.76   |
| 公允价值变动       | 14,510,616.76     | 190,168,876.44    |                | -1,725,937.20    | 21,834,361.57     |                    | 224,787,917.57     |
| (2) 营业支出     | 2,473,292,592.69  | 132,239,240.70    | 53,735,147.16  | 299,860,599.81   | 2,481,408,772.41  | -46,346,305.75     | 5,394,190,047.02   |
| (3) 营业利润(亏损) | 6,901,516,441.14  | 1,557,775,871.65  | 62,323,822.31  | 118,744,348.07   | -3,047,161,388.75 | -72,399,434.82     | 5,520,799,659.60   |
| (4) 资产总额     | 77,686,216,990.82 | 15,785,011,545.68 | 282,764,326.58 | 1,470,581,753.64 | 73,394,893,406.55 | -14,194,261,640.21 | 154,425,206,383.05 |
| (5) 负债总额     | 55,016,654,533.04 | 10,872,221,133.70 | 23,331,147.16  | 113,009,276.32   | 53,972,237,950.01 | -1,096,971,076.80  | 118,900,482,963.43 |
| (6) 补充信息     |                   |                   |                |                  |                   |                    |                    |
| 1) 折旧和摊销费用   | 58,655,899.91     | 1,399,540.79      | 639,459.78     | 7,869,813.46     | 83,615,905.67     |                    | 152,180,619.61     |
| 2) 资本性支出     | 73,109,563.04     | 139,411.72        | 253,816.94     | 4,173,284.02     | 104,813,653.62    |                    | 182,489,729.34     |
| 3) 资产减值损失    | 11,486,295.75     | 527,442,417.25    | -70,879.99     | 329,523.77       | -82,274,007.35    |                    | 456,913,349.43     |

(二) 受托客户资产管理业务

| 资 产       | 期末数                | 期初数                |
|-----------|--------------------|--------------------|
| 银行存款      | 4,166,403,802.03   | 472,531,019.75     |
| 结算备付金     | 904,628,498.85     | 127,640,447.70     |
| 存出与托管客户资金 | 4,061,250.04       | 1,984,111.96       |
| 应收款项      | 2,818,539,557.30   | 579,001,945.35     |
| 受托投资      | 214,352,423,089.89 | 127,828,118,957.35 |
| 其中：投资成本   | 214,081,335,880.09 | 128,369,670,007.02 |
| 已实现未结算损益  | 271,087,209.80     | -541,551,049.67    |
| 受托资产总计    | 222,246,056,198.11 | 129,009,276,482.11 |

(续上表)

| 负债与持有人权益 | 期末数                | 期初数                |
|----------|--------------------|--------------------|
| 受托资金     | 216,221,831,994.06 | 126,326,828,078.44 |
| 应付款项     | 6,024,224,204.05   | 2,682,448,403.67   |
| 受托负债总计   | 222,246,056,198.11 | 129,009,276,482.11 |

(三) 融资融券业务

1. 融资业务明细情况

| 项 目  | 期末数               | 期初数               |
|------|-------------------|-------------------|
| 个人客户 | 22,703,884,035.54 | 30,637,115,427.88 |
| 机构客户 | 377,383,846.28    | 760,959,422.23    |
| 小 计  | 23,081,267,881.82 | 31,398,074,850.11 |

2. 融券业务明细情况

| 项 目         | 期末公允价值        | 期初公允价值        |
|-------------|---------------|---------------|
| 融出证券        | 28,224,650.11 | 17,283,365.06 |
| 其中：可供出售金融资产 | 28,224,650.11 | 17,283,365.06 |

3. 融资融券业务违约概率情况说明

截至 2016 年 12 月 31 日，公司融资融券业务客户维持担保比例均满足监管要求。公司

抵押物充足，如市场不出现极端行情，该业务的违约概率较低。

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

| 担保物类别 | 期末公允价值            | 期初公允价值             |
|-------|-------------------|--------------------|
| 资金    | 3,530,629,120.79  | 6,229,391,089.03   |
| 债券    | 6,970,475.10      | 6,565,169.88       |
| 股票    | 69,187,129,435.99 | 94,608,587,878.10  |
| 基金    | 56,426,782.41     | 148,590,513.54     |
| 小计    | 72,781,155,814.29 | 100,993,134,650.55 |

(四) 社会责任支出

2016 年度，公司为了履行社会责任，在公益性方面的投入金额及构成如下：

| 项 目   | 金 额        | 核算科目  |
|-------|------------|-------|
| 公益性捐赠 | 475,000.00 | 营业外支出 |
| 合 计   | 475,000.00 |       |

(五) 20.5 亿元信托投资处理情况

经过民族证券公司前期自查，2014 年民族证券公司除与恒丰银行股份有限公司(以下简称恒丰银行)签署了同业存款外，还同时签署了委托投资总协议；另外，恒丰银行与四川信托有限公司(以下简称四川信托)签署了信托协议。根据相关协议安排，民族证券公司 20.5 亿元款项并非协议存款，而是以民族证券公司作为委托人，恒丰银行作为通道和受托人，并根据公司的投资指令，全部投向四川信托的单一资金信托计划的委托投资。上述信托投资无担保物，截至 2016 年 12 月 31 日的状况如下：

| 序号 | 投资方向                     | 利率    | 本金<br>(亿元) | 期限                        | 债务人          | 最后还款日      | 已收回<br>本金(亿<br>元) |
|----|--------------------------|-------|------------|---------------------------|--------------|------------|-------------------|
| 1  | 光明石业股份流动资金贷款(一期)单一资金信托计划 | 8.30% | 3.50       | 2014.9.29-<br>2015.9.29   | 光明石业股份有限公司   | 2015.10.21 |                   |
| 2  | 光明石业股份流动资金贷款(二期)单一资金信托计划 | 8.30% | 4.00       | 2014.10.30-<br>2015.10.30 | 光明石业股份有限公司   | 2015.11.16 |                   |
| 3  | 光明石业股份流动资金贷款(三期)单一资金信托计划 | 8.52% | 1.00       | 2014.11.6-<br>2015.11.6   | 光明石业股份有限公司   | 2015.11.23 | 1.00              |
| 4  | 金辉商务流动资金贷款单一资金信托计划       | 8.30% | 2.00       | 2014.11.14-<br>2015.11.14 | 郑州金辉商务信息咨询有限 | 2015.11.30 |                   |

| 序号 | 投资方向                    | 利率    | 本金<br>(亿元) | 期限                        | 债务人                    | 最后还款日      | 已收回<br>本金(亿<br>元) |
|----|-------------------------|-------|------------|---------------------------|------------------------|------------|-------------------|
|    |                         |       |            |                           | 公司                     |            |                   |
| 5  | 郑州熹曼股权收益权1号<br>单一资金信托计划 | 8.55% | 4.20       | 2014.12.4-<br>2015.12.4   | 郑州蓝淮商务<br>咨询有限公司       | 2015.12.21 | 2.085             |
| 6  | 郑州熹曼股权收益权2号<br>单一资金信托计划 | 8.55% | 4.30       | 2014.12.4-<br>2015.12.4   | 郑州恒海商务<br>咨询有限公司       | 2015.12.21 |                   |
| 7  | 周口银行股权收益权单<br>一资金信托计划   | 8.55% | 1.50       | 2014.12.23-<br>2015.12.23 | 郑州金辉商务<br>信息咨询有限<br>公司 | 2016.1.8   |                   |
| 合计 |                         |       | 20.50      |                           |                        |            | 3.085             |

如上表所示,截至2016年12月31日已到期的单一信托投资计划收回本金3.085亿元。

民族证券公司第四届董事会2015年第四次会议审议通过了《关于审议明确单一、无担保的信用投资减值会计政策及计提减值损失的议案》,同意参照中国银行业监督管理委员会颁布的《贷款风险分类指引》(银监发〔2007〕54号)将上述单一、无担保的信用投资进行五级分类,并参照相关标准计提坏账准备。

民族证券公司根据《企业会计准则》,同时参照中国银行业监督管理委员会颁布的《贷款风险分类指引》,对未能按期收回的款项按照30%计提资产减值准备。

2015年9月9日,民族证券公司收到中国证监会《调查通知书》(京调查字15062号)。因调查工作需要,根据证券、基金、期货法律法规的有关规定,中国证监会决定就20.5亿元款项事项对民族证券公司立案调查。

截至2016年12月31日,公司已对相关款项计提5.2245亿元的坏账准备。截至本财务报表报出日,中国证监会尚未出具调查结论。

### 十三、母公司财务报表项目注释

#### (一) 母公司资产负债表项目注释

##### 1. 货币资金

##### (1) 类别明细

| 项 目      | 期末数               | 期初数               |
|----------|-------------------|-------------------|
| 库存现金     | 159,054.73        | 152,028.62        |
| 银行存款     | 19,346,962,079.70 | 28,923,870,707.74 |
| 其中: 客户存款 | 17,192,865,356.52 | 23,612,984,127.88 |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 公司存款          | 2,154,096,723.18  | 5,310,886,579.86  |
| 其他货币资金        | 7,079,261.44      | 29,104,570.45     |
| 合计            | 19,354,200,395.87 | 28,953,127,306.81 |
| 其中：存放在境外的款项总额 |                   |                   |

(2) 币种明细

| 项 目       | 期末数           |        |                   |
|-----------|---------------|--------|-------------------|
|           | 原币金额          | 汇率     | 人民币金额             |
| 库存现金：     |               |        |                   |
| 人民币       |               |        | 1,038.41          |
| 美元        | 21,079.00     | 6.9370 | 146,225.02        |
| 港币        | 13,182.00     | 0.8945 | 11,791.30         |
| 小 计       |               |        | 159,054.73        |
| 银行存款：     |               |        |                   |
| 其中：客户资金存款 |               |        |                   |
| 人民币       |               |        | 16,788,006,047.63 |
| 美元        | 46,644,157.67 | 6.9370 | 323,570,521.71    |
| 港币        | 90,876,229.40 | 0.8945 | 81,288,787.18     |
| 小 计       |               |        | 17,192,865,356.52 |
| 自有资金存款    |               |        |                   |
| 人民币       |               |        | 2,145,390,685.89  |
| 美元        | 1,207,722.70  | 6.9370 | 8,377,972.37      |
| 港币        | 366,757.88    | 0.8945 | 328,064.92        |
| 小 计       |               |        | 2,154,096,723.18  |
| 银行存款合计    |               |        | 19,346,962,079.70 |
| 其他货币资金：   |               |        |                   |
| 人民币       |               |        | 7,079,261.44      |
| 小 计       |               |        | 7,079,261.44      |
| 合计        |               |        | 19,354,200,395.87 |

(续上表)

| 项 目   | 期初数  |    |          |
|-------|------|----|----------|
|       | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额    |
| 库存现金： |      |    |          |
| 人民币   |      |    | 4,106.15 |

| 项 目        | 期初数            |        |                   |
|------------|----------------|--------|-------------------|
|            | 原币金额           | 汇率     | 人民币金额             |
| 美元         | 21,079.00      | 6.4936 | 136,878.59        |
| 港币         | 13,182.00      | 0.8378 | 11,043.88         |
| 小 计        |                |        | 152,028.62        |
| 银行存款:      |                |        |                   |
| 其中: 客户资金存款 |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 23,159,410,574.89 |
| 美元         | 54,320,248.81  | 6.4936 | 352,733,967.63    |
| 港币         | 120,362,360.17 | 0.8378 | 100,839,585.36    |
| 小 计        |                |        | 23,612,984,127.88 |
| 自有资金存款     |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 5,303,640,253.80  |
| 美元         | 1,081,740.66   | 6.4936 | 7,024,391.15      |
| 港币         | 264,902.02     | 0.8378 | 221,934.91        |
| 小 计        |                |        | 5,310,886,579.86  |
| 银行存款合计     |                |        | 28,923,870,707.74 |
| 其他货币资金:    |                |        |                   |
| 人民币        |                |        | 29,104,570.45     |
| 小 计        |                |        | 29,104,570.45     |
| 合计         |                |        | 28,953,127,306.81 |

(3) 融资融券业务信用资金明细情况

| 项 目     | 期末数  |    |                  |
|---------|------|----|------------------|
|         | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额            |
| 客户信用资金: |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 1,912,072,317.53 |
| 小 计     |      |    | 1,912,072,317.53 |
| 公司信用资金: |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 3,178,788.06     |
| 小 计     |      |    | 3,178,788.06     |
| 总 计     |      |    | 1,915,251,105.59 |

(续上表)

| 项 目 | 期初数 |
|-----|-----|
|-----|-----|

|         | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额            |
|---------|------|----|------------------|
| 客户信用资金: |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 3,026,909,633.84 |
| 小 计     |      |    | 3,026,909,633.84 |
| 公司信用资金: |      |    |                  |
| 人民币     |      |    | 18,051,158.44    |
| 小 计     |      |    | 18,051,158.44    |
| 总 计     |      |    | 3,044,960,792.28 |

(4) 使用受限的资金情况

| 项目或账户性质 | 限制条件或变相方面的其他重大限制 | 期末数            |
|---------|------------------|----------------|
| 共管账户    | 政府补贴             | 143,778,745.98 |
| 合 计     |                  | 143,778,745.98 |

2. 结算备付金

| 项 目      | 期末数           |        |                  |
|----------|---------------|--------|------------------|
|          | 原币金额          | 汇率     | 人民币金额            |
| 客户普通备付金: |               |        |                  |
| 人民币      |               |        | 4,244,777,058.13 |
| 美元       | 17,500,791.18 | 6.9370 | 121,402,988.42   |
| 港币       | 9,497,756.86  | 0.8945 | 8,495,743.51     |
| 小 计      |               |        | 4,374,675,790.06 |
| 客户备付金合计  |               |        | 4,374,675,790.06 |
| 公司普通备付金: |               |        |                  |
| 人民币      |               |        | 1,556,300,117.25 |
| 小 计      |               |        | 1,556,300,117.25 |
| 公司信用备付金: |               |        |                  |
| 人民币      |               |        | 1,132,612,553.05 |
| 小 计      |               |        | 1,132,612,553.05 |
| 公司备付金合计  |               |        | 2,688,912,670.30 |
| 总 计      |               |        | 7,063,588,460.36 |

(续上表)

| 项 目      | 期初数           |        |                   |
|----------|---------------|--------|-------------------|
|          | 原币金额          | 汇率     | 人民币金额             |
| 客户普通备付金: |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 7,777,520,020.66  |
| 美元       | 23,801,698.34 | 6.4936 | 154,558,708.34    |
| 港币       | 28,644,873.49 | 0.8378 | 23,998,675.01     |
| 小 计      |               |        | 7,956,077,404.01  |
| 客户备付金合计  |               |        | 7,956,077,404.01  |
| 公司普通备付金: |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 1,641,559,179.72  |
| 小 计      |               |        | 1,641,559,179.72  |
| 公司信用备付金: |               |        |                   |
| 人民币      |               |        | 2,791,120,497.08  |
| 小 计      |               |        | 2,791,120,497.08  |
| 公司备付金合计  |               |        | 4,432,679,676.80  |
| 总 计      |               |        | 12,388,757,080.81 |

### 3. 融出资金

#### (1) 明细情况——按类别

| 项 目        | 期末数               | 期初数               |
|------------|-------------------|-------------------|
| 融资融券业务融出资金 | 17,252,900,873.93 | 23,746,053,363.76 |
| 减: 减值准备    |                   |                   |
| 合 计        | 17,252,900,873.93 | 23,746,053,363.76 |

#### (2) 明细情况——按客户

| 项 目  | 期末数               | 期初数               |
|------|-------------------|-------------------|
| 个人客户 | 16,963,907,169.55 | 23,064,251,221.60 |
| 机构客户 | 288,993,704.38    | 681,802,142.16    |
| 合 计  | 17,252,900,873.93 | 23,746,053,363.76 |

(3) 按账龄分析

| 账 龄    | 期末数               |        | 期初数               |        |
|--------|-------------------|--------|-------------------|--------|
|        | 账面余额              |        | 账面余额              |        |
|        | 金额                | 比例 (%) | 金额                | 比例 (%) |
| 1-3 个月 | 10,326,462,165.48 | 59.85  | 17,079,138,885.57 | 71.92  |
| 3-6 个月 | 2,599,029,126.40  | 15.06  | 2,179,647,119.11  | 9.18   |
| 6 个月以上 | 4,327,409,582.05  | 25.09  | 4,487,267,359.08  | 18.90  |
| 合 计    | 17,252,900,873.93 | 100.00 | 23,746,053,363.76 | 100.00 |

4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 明细情况

| 项 目 | 期末数               |                                 |                   |
|-----|-------------------|---------------------------------|-------------------|
|     | 为交易目的而持有的<br>金融资产 | 指定以公允价值计量且变<br>动计入当期损益的<br>金融资产 | 合计                |
| 债券  | 13,354,265,220.21 |                                 | 13,354,265,220.21 |
| 基金  | 6,207,530,140.83  |                                 | 6,207,530,140.83  |
| 股票  | 742,594,098.08    |                                 | 742,594,098.08    |
| 合 计 | 20,304,389,459.12 |                                 | 20,304,389,459.12 |

(续上表)

| 项 目 | 期初数               |                                 |                   |
|-----|-------------------|---------------------------------|-------------------|
|     | 为交易目的而持有的<br>金融资产 | 指定以公允价值计量且变<br>动计入当期损益的<br>金融资产 | 合计                |
| 债券  | 16,613,776,737.34 |                                 | 16,613,776,737.34 |
| 基金  | 2,017,596,632.61  |                                 | 2,017,596,632.61  |
| 股票  | 476,387,567.61    |                                 | 476,387,567.61    |
| 合 计 | 19,107,760,937.56 |                                 | 19,107,760,937.56 |

(2) 变现有限制的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

| 项 目 | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数              |
|-----|------------------|------------------|
| 债券  | 债券回购业务质押         | 5,120,650,054.30 |
| 债券  | 报价回购业务质押         | 148,937,000.00   |

|     |  |                  |
|-----|--|------------------|
| 小 计 |  | 5,269,587,054.30 |
|-----|--|------------------|

5. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按交易品种

| 项 目    | 期末数              | 期初数              |
|--------|------------------|------------------|
| 股票     | 8,404,597,902.00 | 2,137,992,700.00 |
| 债券     | 1,416,987,410.06 | 1,512,069,124.41 |
| 减：减值准备 |                  |                  |
| 合 计    | 9,821,585,312.06 | 3,650,061,824.41 |

(2) 明细情况——按业务类别

| 项 目       | 期末数              | 期初数              |
|-----------|------------------|------------------|
| 约定购回式证券   | 104,101,000.00   | 95,652,700.00    |
| 股票质押式回购   | 8,300,496,902.00 | 2,042,340,000.00 |
| 交易所回购业务   | 780,809,000.00   | 351,400,000.00   |
| 银行间市场回购业务 | 636,178,410.06   | 1,160,669,124.41 |
| 合 计       | 9,821,585,312.06 | 3,650,061,824.41 |

(3) 约定购回融出资金

| 剩余期限              | 期末数            | 期初数           |
|-------------------|----------------|---------------|
| 1 个月内(含 1 个月, 下同) | 2,620,000.00   | 19,080,300.00 |
| 1 个月至 3 个月内       | 7,500,000.00   | 31,370,000.00 |
| 3 个月至 1 年内        | 93,981,000.00  | 45,202,400.00 |
| 小 计               | 104,101,000.00 | 95,652,700.00 |

(4) 质押回购融出资金

| 剩余期限              | 期末数              | 期初数              |
|-------------------|------------------|------------------|
| 1 个月内(含 1 个月, 下同) | 193,483,800.00   | 7,922,100.00     |
| 1 个月至 3 个月内       | 422,967,102.00   | 56,256,200.00    |
| 3 个月至 1 年内        | 3,710,417,700.00 | 1,579,689,900.00 |
| 1 年以上             | 3,973,628,300.00 | 398,471,800.00   |
| 小 计               | 8,300,496,902.00 | 2,042,340,000.00 |

(5) 担保物情况

期末公司开展约定购回业务融出资金收取的担保物价值 215,992,788.87 元,开展质押回购业务融出资金收取的担保物价值 21,362,037,313.10 元,公司开展普通证券回购业务已收取足额的担保物。

6. 应收款项

(1) 类别明细情况

| 种 类      | 期末数            |        |               |        |
|----------|----------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额           |        | 坏账准备          |        |
|          | 金额             | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 组合计提坏账准备 | 785,985,733.89 | 100.00 | 15,321,960.31 | 1.95   |
| 合 计      | 785,985,733.89 | 100.00 | 15,321,960.31 | 1.95   |

(续上表)

| 种 类      | 期初数            |        |               |        |
|----------|----------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额           |        | 坏账准备          |        |
|          | 金额             | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 组合计提坏账准备 | 191,281,985.24 | 100.00 | 14,943,194.98 | 7.81   |
| 合 计      | 191,281,985.24 | 100.00 | 14,943,194.98 | 7.81   |

(2) 按账龄分析

| 账 龄   | 期末数            |        |               |
|-------|----------------|--------|---------------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |
|       | 金额             | 比例 (%) |               |
| 1 年以内 | 782,660,866.81 | 99.58  | 14,211,115.19 |
| 1-2 年 | 2,093,030.81   | 0.27   | 209,303.07    |
| 3-4 年 | 419,634.85     | 0.05   | 251,780.91    |
| 4-5 年 | 812,201.42     | 0.10   | 649,761.14    |
| 小 计   | 785,985,733.89 | 100.00 | 15,321,960.31 |

(续上表)

| 账 龄   | 期初数            |        |               |
|-------|----------------|--------|---------------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |
|       | 金额             | 比例 (%) |               |
| 1 年以内 | 190,050,148.97 | 99.36  | 14,371,947.16 |

| 账 龄   | 期初数            |        |               |
|-------|----------------|--------|---------------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |
|       | 金额             | 比例 (%) |               |
| 2-3 年 | 419,634.85     | 0.22   | 83,926.97     |
| 3-4 年 | 812,201.42     | 0.42   | 487,320.85    |
| 小 计   | 191,281,985.24 | 100.00 | 14,943,194.98 |

(3) 按款项性质

| 项 目      | 期末数            | 期初数            |
|----------|----------------|----------------|
| 应收清算款项   | 358,425,035.34 | 43,971,661.04  |
| 应收融资融券款  | 293,823,706.00 | 33,561,571.33  |
| 应收手续费及佣金 | 122,264,515.92 | 112,819,301.25 |
| 应收资产管理费  | 11,472,476.63  | 929,451.62     |
| 合 计      | 785,985,733.89 | 191,281,985.24 |
| 减：减值准备   | 15,321,960.31  | 14,943,194.98  |
| 应收款项账面价值 | 770,663,773.58 | 176,338,790.26 |

7. 可供出售金融资产

(1) 按投资品种类别列示

1) 以公允价值计量

| 项 目      | 期末数               |                 |               |                   |
|----------|-------------------|-----------------|---------------|-------------------|
|          | 初始成本              | 公允价值变动          | 减值准备          | 账面价值              |
| 债券       | 11,205,382,381.14 | -51,671,118.19  |               | 11,153,711,262.95 |
| 基金       | 8,207,765.25      | -400,259.13     |               | 7,807,506.12      |
| 股票       | 86,045,472.73     | 5,679,599.15    | 10,816,928.96 | 80,908,142.92     |
| 证券公司理财产品 | 2,534,883,133.81  | 21,779,958.63   | 16,286,575.42 | 2,540,376,517.02  |
| 信托计划     | 722,900,000.00    |                 |               | 722,900,000.00    |
| 其他       | 6,683,410,000.00  | -403,938,441.78 |               | 6,279,471,558.22  |
| 小 计      | 21,240,828,752.93 | -428,550,261.32 | 27,103,504.38 | 20,785,174,987.23 |

(续上表)

| 项 目 | 期初数  |        |      |      |
|-----|------|--------|------|------|
|     | 初始成本 | 公允价值变动 | 减值准备 | 账面价值 |

| 项 目      | 期初数               |                 |               |                   |
|----------|-------------------|-----------------|---------------|-------------------|
|          | 初始成本              | 公允价值变动          | 减值准备          | 账面价值              |
| 债券       | 4,269,457,692.67  | 306,241,342.04  |               | 4,575,699,034.71  |
| 基金       | 17,721,232.37     | 3,979,046.89    |               | 21,700,279.26     |
| 股票       | 54,183,235.43     | 18,581,864.40   | 2,517,898.71  | 70,247,201.12     |
| 证券公司理财产品 | 69,772,758.74     | 12,147,525.13   | 16,286,575.42 | 65,633,708.45     |
| 银行理财产品   | 70,000,000.00     |                 |               | 70,000,000.00     |
| 信托计划     | 27,000,000.00     |                 |               | 27,000,000.00     |
| 其他       | 6,733,310,000.00  | -302,112,020.38 |               | 6,431,197,979.62  |
| 小 计      | 11,241,444,919.21 | 38,837,758.08   | 18,804,474.13 | 11,261,478,203.16 |

2) 以成本计量

| 项 目       | 期末数              |              |                  |
|-----------|------------------|--------------|------------------|
|           | 投资成本             | 减值准备         | 账面价值             |
| 非上市公司股权投资 | 2,422,344,612.06 | 2,200,386.42 | 2,420,144,225.64 |
| 小 计       | 2,422,344,612.06 | 2,200,386.42 | 2,420,144,225.64 |

(续上表)

| 项 目       | 期初数              |              |                  |
|-----------|------------------|--------------|------------------|
|           | 投资成本             | 减值准备         | 账面价值             |
| 非上市公司股权投资 | 2,422,404,829.06 | 2,260,603.42 | 2,420,144,225.64 |
| 小 计       | 2,422,404,829.06 | 2,260,603.42 | 2,420,144,225.64 |

(2) 期末按公允价值计量的可供出售金额资产

| 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          | 小 计               |
|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 权益工具的成本/债务工具的摊余成本   | 10,035,446,371.79 | 11,205,382,381.14 | 21,240,828,752.93 |
| 公允价值                | 9,631,463,724.28  | 11,153,711,262.95 | 20,785,174,987.23 |
| 累计计入其他综合收益的公允价值变动金额 | -376,879,143.13   | -51,671,118.19    | -428,550,261.32   |
| 已计提减值金额             | 27,103,504.38     |                   | 27,103,504.38     |

(3) 可供出售金融资产减值准备的变动情况

| 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 | 小 计 |
|------------|----------|----------|-----|
|------------|----------|----------|-----|

| 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 | 小 计           |
|---------------|---------------|----------|---------------|
| 期初已计提减值金额     | 21,065,077.55 |          | 21,065,077.55 |
| 本期计提          | 9,193,162.78  |          | 9,193,162.78  |
| 其中：从其他综合收益转入  | 9,193,162.78  |          | 9,193,162.78  |
| 本期减少          | 954,349.53    |          | 954,349.53    |
| 其中：期后公允价值回升转回 |               |          |               |
| 期末已计提减值金额     | 29,303,890.80 |          | 29,303,890.80 |

(4) 变现有限制的可供出售金融资产

| 项 目 | 限制条件或变现方面的其他重大限制 | 期末数               |
|-----|------------------|-------------------|
| 债券  | 债券回购业务质押         | 9,688,636,233.62  |
| 债券  | 报价回购业务质押         | 847,387,680.00    |
| 小 计 |                  | 10,536,023,913.62 |

8. 长期股权投资

(1) 明细情况

| 项 目    | 期末数               |      |                   |
|--------|-------------------|------|-------------------|
|        | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              |
| 对子公司投资 | 16,536,081,013.48 |      | 16,536,081,013.48 |
| 合 计    | 16,536,081,013.48 |      | 16,536,081,013.48 |

(续上表)

| 项 目    | 期初数               |      |                   |
|--------|-------------------|------|-------------------|
|        | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              |
| 对子公司投资 | 16,402,681,013.48 |      | 16,402,681,013.48 |
| 合 计    | 16,402,681,013.48 |      | 16,402,681,013.48 |

(2) 对子公司投资

| 被投资单位   | 期初数              | 增减变动数 | 期末数              | 期末持股比例 (%) |
|---------|------------------|-------|------------------|------------|
| 方正中期公司  | 861,471,843.48   |       | 861,471,843.48   | 90.62      |
| 瑞信方正公司  | 533,600,000.00   |       | 533,600,000.00   | 66.70      |
| 方正和生投资有 | 1,700,000,000.00 |       | 1,700,000,000.00 | 100.00     |

| 被投资单位            | 期初数               | 增减变动数          | 期末数               | 期末持股比例 (%) |
|------------------|-------------------|----------------|-------------------|------------|
| 限责任公司            |                   |                |                   |            |
| 方正富邦公司           | 133,400,000.00    | 133,400,000.00 | 266,800,000.00    | 66.70      |
| 民族证券公司           | 12,792,608,370.00 |                | 12,792,608,370.00 | 100.00     |
| 方正证券(香港)金融控股有限公司 | 81,600,800.00     |                | 81,600,800.00     | 100.00     |
| 方正投资公司           | 300,000,000.00    |                | 300,000,000.00    | 100.00     |
| 合计               | 16,402,681,013.48 | 133,400,000.00 | 16,536,081,013.48 |            |

### 9. 卖出回购金融资产款

#### (1) 明细情况——按交易品种

| 项目      | 期末数               | 期初数               |
|---------|-------------------|-------------------|
| 债券      | 15,129,225,835.61 | 9,777,060,453.55  |
| 融资融券收益权 | 1,496,000,000.00  | 9,270,000,000.00  |
| 其他      |                   | 203,000,000.00    |
| 合计      | 16,625,225,835.61 | 19,250,060,453.55 |

#### (2) 明细情况——按业务类型

| 项目        | 期末数               | 期初数               |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 债券质押式回购   | 14,164,431,000.00 | 7,069,200,000.00  |
| 债券买断式回购业务 | 360,911,835.61    | 1,761,219,453.55  |
| 报价回购业务    | 603,883,000.00    | 946,641,000.00    |
| 场外协议回购业务  | 1,496,000,000.00  | 9,473,000,000.00  |
| 合计        | 16,625,225,835.61 | 19,250,060,453.55 |

#### (3) 报价回购融入资金

| 剩余期限                  | 期末数            |            | 期初数            |           |
|-----------------------|----------------|------------|----------------|-----------|
|                       | 金额             | 利率区间       | 金额             | 利率区间      |
| 1 个月内<br>(含 1 个月, 下同) | 482,612,000.00 | 2.2%-3.45% | 854,416,000.00 | 1.7%-4.0% |
| 1 个月至 3 个月内           | 78,818,000.00  |            | 62,650,000.00  |           |

|            |                |  |                |  |
|------------|----------------|--|----------------|--|
| 3 个月至 1 年内 | 42,453,000.00  |  | 29,575,000.00  |  |
| 小 计        | 603,883,000.00 |  | 946,641,000.00 |  |

(4) 担保物情况

期末，债券质押式回购业务对应的债券质押的账面价值为人民币 15,058,217,183.78 元；报价回购业务对应质押债券的账面价值为人民币 1,153,066,301.49 元；期末质押的融资融券债权收益权金额为人民币 1,361,157,813.64 元；股票质押式回购收益权所对应的债权金额为人民币 246,000,000.00 元。

10. 代理买卖证券款

(1) 明细情况

| 项 目    | 期末数               | 期初数               |
|--------|-------------------|-------------------|
| 普通经纪业务 | 19,617,937,523.11 | 28,608,478,543.08 |
| 其中：个人  | 18,527,732,072.31 | 27,067,977,362.75 |
| 机构     | 1,090,205,450.80  | 1,540,501,180.33  |
| 信用业务   | 2,607,415,588.21  | 4,547,795,149.80  |
| 其中：个人  | 2,462,516,631.15  | 4,426,147,198.03  |
| 机构     | 144,898,957.06    | 121,647,951.77    |
| 合 计    | 22,225,353,111.32 | 33,156,273,692.88 |

(2) 代理买卖证券款——外币款项

| 币 种 | 期末数            |        |                |
|-----|----------------|--------|----------------|
|     | 原币金额           | 汇率     | 折人民币金额         |
| 美元  | 63,838,920.78  | 6.9370 | 442,850,593.45 |
| 港币  | 101,939,103.92 | 0.8945 | 91,184,528.46  |
| 小 计 |                |        | 534,035,121.91 |

(续上表)

| 币 种 | 期初数            |        |                |
|-----|----------------|--------|----------------|
|     | 原币金额           | 汇率     | 折人民币金额         |
| 美元  | 77,190,786.62  | 6.4936 | 501,246,091.98 |
| 港币  | 148,317,130.56 | 0.8378 | 124,260,092.04 |
| 小 计 |                |        | 625,506,184.02 |

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

| 项 目                      | 本期数              | 上年同期数            |
|--------------------------|------------------|------------------|
| 手续费及佣金收入                 | 3,522,188,254.70 | 6,799,432,701.63 |
| 证券经纪业务                   | 3,116,526,876.39 | 6,513,620,259.01 |
| 其中：代理买卖证券业务              | 2,797,099,875.29 | 6,157,611,606.75 |
| 交易单元席位租赁                 | 281,140,743.55   | 326,414,936.80   |
| 代销金融产品业务                 | 38,286,257.55    | 29,593,715.46    |
| 投资银行业务                   | 192,048,630.89   | 129,785,408.06   |
| 其中：财务顾问业务                | 192,048,630.89   | 129,785,408.06   |
| 资产管理业务                   | 152,991,550.50   | 78,743,043.86    |
| 投资咨询业务                   | 36,720,570.73    | 56,042,087.39    |
| 其他                       | 23,900,626.19    | 21,241,903.31    |
|                          |                  |                  |
| 手续费及佣金支出                 | 503,016,255.71   | 309,458,698.31   |
| 证券经纪业务                   | 455,130,966.10   | 307,535,406.07   |
| 其中：代理买卖证券业务              | 455,130,966.10   | 307,535,406.07   |
| 投资银行业务                   |                  | 300,000.00       |
| 其中： 财务顾问业务               |                  | 300,000.00       |
| 资产管理业务                   | 300,275.05       |                  |
| 其他                       | 47,585,014.56    | 1,623,292.24     |
|                          |                  |                  |
| 手续费及佣金净收入                | 3,019,171,998.99 | 6,489,974,003.32 |
| 其中：财务顾问业务净收入             | 192,048,630.89   | 129,485,408.06   |
| —并购重组财务顾问业务—<br>入—境内上市公司 |                  |                  |
| —并购重组财务顾问业务—<br>入—其他     |                  |                  |
| —其他财务顾问业务净收入             | 192,048,630.89   | 129,485,408.06   |

(2) 代销金融产品业务收入

| 项 目   | 本期数                |               |
|-------|--------------------|---------------|
|       | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金及其他 | 334,734,845,056.81 | 38,286,257.55 |
| 小 计   | 334,734,845,056.81 | 38,286,257.55 |

(续上表)

| 项 目   | 上年同期数              |               |
|-------|--------------------|---------------|
|       | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金及其他 | 213,086,637,097.97 | 29,593,715.46 |
| 小 计   | 213,086,637,097.97 | 29,593,715.46 |

(3) 资产管理业务收入

| 项目               | 集合资产管理<br>业务      | 定向资产管理<br>业务       | 专项资产管理<br>业务     |
|------------------|-------------------|--------------------|------------------|
| 期末产品数量           | 36.00             | 381.00             | 5.00             |
| 期末客户数量           | 77,428.00         | 381.00             | 25.00            |
| 其中：个人客户          | 77,242.00         | 184.00             |                  |
| 机构客户             | 186.00            | 197.00             | 25.00            |
| 期初受托资金           | 2,318,934,447.14  | 41,104,184,862.98  | 630,000,000.00   |
| 其中：自有资金投入        | 69,772,893.74     |                    |                  |
| 个人客户             | 433,006,409.28    |                    |                  |
| 机构客户             | 1,816,155,144.12  | 41,104,184,862.98  | 630,000,000.00   |
| 期末受托资金           | 20,240,863,989.27 | 159,115,408,115.88 | 2,595,545,064.98 |
| 其中：自有资金投入        | 333,653,423.17    |                    | 95,000,000.00    |
| 个人客户             | 15,434,865,576.38 | 1,337,131,000.00   |                  |
| 机构客户             | 4,472,344,989.72  | 157,778,277,115.88 | 2,500,545,064.98 |
| 期末主要受托资产初始<br>成本 | 18,519,162,891.77 | 159,480,587,435.45 | 2,625,178,125.34 |
| 其中：股票            | 1,386,487,096.61  | 2,326,824.00       |                  |
| 基金               | 1,507,693,446.77  | 4,413,888,914.83   |                  |
| 债券               | 9,429,881,038.29  | 11,053,043,804.16  |                  |
| 资产支持证券           | 1,884,525,686.25  | 1,336,204,822.88   |                  |

| 项目              | 集合资产管理<br>业务     | 定向资产管理<br>业务      | 专项资产管理<br>业务     |
|-----------------|------------------|-------------------|------------------|
| 股指期货(套保)        |                  |                   |                  |
| 银行理财计划          | 62,000,000.00    | 24,255,120,000.00 |                  |
| 信托计划            |                  | 19,393,552,933.53 |                  |
| 专项资产管理计<br>划    |                  | 1,000,000,000.00  |                  |
| 银行承兑汇票          |                  | 1,130,556,931.02  |                  |
| 资产收益权           |                  | 31,911,845,983.95 | 2,625,178,125.34 |
| 其他投资产品          | 4,248,575,623.85 | 64,984,047,221.08 |                  |
| 当期资产管理业务净收<br>入 | 88,084,014.78    | 58,540,056.06     | 6,067,204.61     |

## 2. 利息净收入

| 项 目           | 本期数              | 上年同期数            |
|---------------|------------------|------------------|
| 利息收入          | 2,536,168,659.72 | 3,615,341,109.40 |
| 存放金融同业利息收入    | 771,599,719.18   | 1,126,604,180.77 |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 262,314,144.58   | 351,419,741.14   |
| 客户资金存款利息收入    | 509,285,574.60   | 775,184,439.63   |
| 融资融券利息收入      | 1,383,610,789.25 | 2,363,460,091.94 |
| 买入返售金融资产利息收入  | 375,145,123.21   | 125,276,836.69   |
| 其中：约定购回利息收入   | 5,339,967.47     | 19,632,343.61    |
| 股权质押回购利息收入    | 345,344,564.41   | 93,462,382.57    |
| 其他            | 5,813,028.08     |                  |
| 利息支出          | 2,949,693,129.91 | 3,050,707,272.15 |
| 客户资金存款利息支出    | 98,226,026.65    | 147,968,993.00   |
| 卖出回购金融资产利息支出  | 804,933,374.61   | 1,206,765,811.89 |
| 其中：报价回购利息支出   | 23,428,602.10    | 26,736,988.97    |
| 短期融资款利息支出     | 188,049,331.83   | 433,030,908.82   |
| 拆入资金利息支出      | 23,926,688.01    | 154,816,272.52   |

| 项 目        | 本期数              | 上年同期数            |
|------------|------------------|------------------|
| 其中：转融通利息支出 | 42,301.97        | 133,096,794.46   |
| 次级债券利息支出   | 1,834,413,058.29 | 1,108,125,285.92 |
| 其他         | 144,650.52       |                  |
| 利息净收入      | -413,524,470.19  | 564,633,837.25   |

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

| 项 目                     | 本期数              | 上年同期数            |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 成本法核算的长期股权投资收益          | 1,000,000,000.00 |                  |
| 金融工具投资收益                | 1,840,218,729.71 | 1,908,924,843.35 |
| 其中：持有期间取得的收益            | 1,434,658,387.79 | 1,113,380,967.04 |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 933,046,927.09   | 536,906,667.90   |
| —持有至到期投资                | 55,451,384.34    | 111,258,488.74   |
| —可供出售金融资产               | 446,160,076.36   | 465,215,810.40   |
| 处置金融工具取得的收益             | 405,560,341.92   | 795,543,876.31   |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 120,696,751.79   | 332,177,965.26   |
| —持有至到期投资                | 21,851,420.66    | 20,715,586.94    |
| —可供出售金融资产               | 295,990,709.05   | 160,481,798.46   |
| —衍生金融工具                 | -32,978,539.58   | 282,168,525.65   |
| 合 计                     | 2,840,218,729.71 | 1,908,924,843.35 |

#### (2) 按成本法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位        | 本期数              | 上年同期数 |
|--------------|------------------|-------|
| 方正和生投资有限责任公司 | 600,000,000.00   |       |
| 民族证券公司       | 400,000,000.00   |       |
| 小 计          | 1,000,000,000.00 |       |

### 4. 业务及管理费

| 项 目       | 本期数              | 上年同期数            |
|-----------|------------------|------------------|
| 职工薪酬      | 1,721,924,909.58 | 2,193,244,724.00 |
| 租赁及物业费    | 151,759,461.68   | 131,137,048.14   |
| 营销费用      | 175,818,610.11   | 141,993,588.41   |
| 证券投资者保护基金 | 134,069,478.98   | 68,830,012.91    |
| 折旧及摊销费    | 102,984,927.11   | 95,630,247.00    |
| 公杂费       | 46,606,796.55    | 50,648,906.86    |
| 差旅费       | 42,713,740.12    | 29,993,349.64    |
| 邮电通讯费     | 34,319,152.10    | 36,165,933.93    |
| 咨询费       | 13,402,847.88    | 7,772,594.00     |
| 其他        | 208,967,587.61   | 255,155,016.62   |
| 合 计       | 2,632,567,511.72 | 3,010,571,421.51 |

(三) 母公司现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

| 项 目         | 本期数              | 上年同期数            |
|-------------|------------------|------------------|
| 持有至到期现金净减少额 | 769,485,177.02   | 582,614,548.32   |
| 存入交易所的保证金净额 | 163,138,093.88   | 371,475,771.44   |
| 权益类收益互换保证金  | 149,155,296.52   |                  |
| 收到财政奖励及补贴   | 40,619,948.44    | 17,424,900.00    |
| 租赁、咨询收入     | 16,680,783.14    | 20,376,099.88    |
| 冻结资金的净减少额   |                  | 1,772,486,058.61 |
| 衍生金融工具的投资收益 |                  | 282,168,525.65   |
| 收到其他与经营活动有关 | 6,749,297.07     | 14,308,616.10    |
| 合 计         | 1,145,828,596.07 | 3,060,854,520.00 |

2. 支付其他与经营活动有关的现金

| 项 目            | 本期数              | 上年同期数            |
|----------------|------------------|------------------|
| 可供出售金融资产现金净增加额 | 9,698,680,591.37 | 2,382,080,935.43 |
| 营业费用及往来        | 672,763,392.41   | 538,955,049.35   |

|              |                   |                  |
|--------------|-------------------|------------------|
| 应收证券清算款净增加额  | 257,001,500.59    |                  |
| 支付的投资者保护基金   | 108,369,258.98    | 50,461,022.42    |
| 衍生金融工具的投资净支出 | 36,739,598.29     |                  |
| 受限资金的净增加额    | 96,642,415.18     |                  |
| 罚款支出         | 23,588,206.86     |                  |
| 赔偿支出         | 35,499,971.80     |                  |
| 以现金支付的其他     | 64,547,267.63     | 73,052,195.40    |
| 合 计          | 10,993,832,203.11 | 3,044,549,202.60 |

3. 收到其他与投资活动有关的现金

| 项 目        | 本期数           | 上年同期数 |
|------------|---------------|-------|
| 与资产相关的政府补助 | 96,304,000.00 |       |
| 合 计        | 96,304,000.00 |       |

4. 支付其他与投资活动有关的现金

| 项 目    | 本期数              | 上年同期数 |
|--------|------------------|-------|
| 子公司拆借款 | 1,117,000,000.00 |       |
| 合 计    | 1,117,000,000.00 |       |

5. 收到其他与筹资活动有关的现金

| 项 目      | 本期数              | 上年同期数            |
|----------|------------------|------------------|
| 短期债及收益凭证 | 6,584,790,000.00 | 5,601,410,000.00 |
| 合 计      | 6,584,790,000.00 | 5,601,410,000.00 |

6. 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

| 补充资料                | 本期数              | 上年同期数            |
|---------------------|------------------|------------------|
| 1) 将净利润调节为经营活动现金流量: |                  |                  |
| 净利润                 | 2,050,308,802.48 | 4,120,569,241.37 |
| 加: 资产减值准备           | 14,136,679.02    | 16,323,384.11    |

| 补充资料                                  | 本期数                | 上年同期数              |
|---------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 固定资产折旧                                | 55,500,135.15      | 48,808,058.10      |
| 无形资产摊销                                | 24,309,360.98      | 19,694,668.27      |
| 长期待摊费用摊销                              | 23,175,430.98      | 27,127,520.63      |
| 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)      | 1,201,077.29       | -6,463,248.92      |
| 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)                   | 328,058,543.85     | -192,398,614.11    |
| 利息支出                                  | 2,022,462,390.12   | 1,541,156,194.74   |
| 汇兑损失(收益以“-”号填列)                       | -1,356,954.90      | -1,027,656.26      |
| 投资损失(收益以“-”号填列)                       | -1,086,230,218.00  | -83,705,100.00     |
| 递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)                  | -94,687,985.62     | 111,249,900.37     |
| 递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)                  |                    | 47,029,319.50      |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少(增加以“-”号填列) | -1,527,644,148.49  | -17,566,946,466.79 |
| 经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)                 | -9,294,263,369.84  | -7,544,954,181.77  |
| 经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)                 | -14,178,597,649.92 | 12,098,639,858.46  |
| 其他                                    |                    |                    |
| 经营活动产生的现金流量净额                         | -21,663,627,906.90 | -7,364,897,122.30  |
| 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                               | 26,274,010,110.25  | 41,294,748,056.82  |
| 减: 现金的期初余额                            | 41,294,748,056.82  | 21,466,146,427.03  |
| 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                          | -15,020,737,946.57 | 19,828,601,629.79  |

(2) 现金和现金等价物的构成

| 项 目 | 期末数 | 期初数 |
|-----|-----|-----|
|-----|-----|-----|

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 1) 现金           | 26,274,010,110.25 | 41,294,748,056.82 |
| 其中：库存现金         | 159,054.73        | 152,028.62        |
| 可随时用于支付的银行存款    | 19,203,183,333.72 | 28,876,734,376.94 |
| 可随时用于支付的结算备付金   | 7,063,588,460.36  | 12,388,757,080.81 |
| 可随时用于支付的其他货币资金  | 7,079,261.44      | 29,104,570.45     |
| 2) 现金等价物        |                   |                   |
| 其中：三个月内到期的债券投资  |                   |                   |
| 3) 期末现金及现金等价物余额 | 26,274,010,110.25 | 41,294,748,056.82 |

(3) 现金流量表补充资料的说明

期末，母公司未作为现金及现金等价物的货币资金金额为 143,778,745.98 元。

**十四、其他补充资料**

(一) 非经常性损益

1. 非经常性损益明细表

| 项 目  | 金 额            |
|--|----------------|
| 非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分                                | -2,803,737.82  |
| 计入当期损益的政府补助(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) | 56,963,487.40  |
| 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                           | -5,359,332.14  |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出   | -42,666,040.33 |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目  |                |
| 小 计  | 6,134,377.11   |
| 减：企业所得税影响数(所得税减少以“-”表示)                                    | 1,068,263.15   |
| 少数股东权益影响额(税后)  | 332,974.02     |
| 归属于母公司所有者的非经常性损益净额   | 4,733,139.94   |

(二) 净资产收益率及每股收益

1. 明细情况

| 报告期利润                       | 加权平均净资产收<br>益率(%) | 每股收益(元/股) |        |
|-----------------------------|-------------------|-----------|--------|
|                             |                   | 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              | 7.31%             | 0.31      | 0.31   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司<br>普通股股东的净利润 | 7.30%             | 0.31      | 0.31   |

2. 加权平均净资产收益率的计算过程

| 项 目                         | 序号  | 本期数               |
|-----------------------------|---|-------------------|
| 归属于公司普通股股东的净利润              | A   | 2,569,336,882.57  |
| 非经常性损益                      | B   | 4,733,139.94      |
| 扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润    | C=A-B   | 2,564,603,742.63  |
| 归属于公司普通股股东的期初净资产            | D   | 34,958,090,717.59 |
| 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 | E   |                   |
| 新增净资产次月起至报告期期末的累计月数         | F   |                   |
| 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  | G   | 740,889,125.55    |
| 减少净资产次月起至报告期期末的累计月数         | H   | 7                 |
| 其他综合收益影响                    | I   | -678,671,046.44   |
| 报告期月份数                      | K   | 12                |
| 加权平均净资产                     | $L = \frac{D+A/2+E \times F/K - G \times H}{K+I}$ | 35,131,902,789.20 |
| 加权平均净资产收益率                  | M=A/L   | 7.31%             |
| 扣除非经常损益加权平均净资产收益率           | N=C/L   | 7.30%             |

### 3. 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

#### (1) 基本每股收益的计算过程

| 项 目                      | 序号    | 本期数              |
|--------------------------|-------|------------------|
| 归属于公司普通股股东的净利润           | A     | 2,569,336,882.57 |
| 非经常性损益                   | B     | 4,733,139.94     |
| 扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润 | C=A-B | 2,564,603,742.63 |
| 期初股份总数                   | D     | 8,232,101,395.00 |
| 因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数    | E     |                  |
| 发行新股或债转股等增加股份数           | F     |                  |
| 增加股份次月起至报告期期末的累计月数       | G     |                  |
| 因回购等减少股份数                | H     |                  |
| 减少股份次月起至报告期期末的累计月数       | I     |                  |
| 报告期缩股数                   | J     |                  |
| 报告期月份数                   | K     | 12               |

| 项 目           | 序号                                  | 本期数              |
|---------------|-------------------------------------|------------------|
| 发行在外的普通股加权平均数 | $L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$ | 8,232,101,395.00 |
| 基本每股收益        | $M=A/L$                             | 0.31             |
| 扣除非经常损益基本每股收益 | $N=C/L$                             | 0.31             |

(2) 稀释每股收益的计算过程

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。

(三) 公司主要财务报表项目的异常情况及原因说明

1. 资产负债表项目

| 项 目                    | 期末数               | 期初数               | 变动幅度    | 变动原因 |
|------------------------|-------------------|-------------------|---------|------|
| 货币资金                   | 31,653,009,147.22 | 47,771,925,975.36 | -33.74% | (1)  |
| 结算备付金                  | 10,401,675,865.84 | 15,255,694,188.31 | -31.82% | (2)  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 35,133,307,565.31 | 25,019,830,145.82 | 40.42%  | (3)  |
| 买入返售金融资产               | 12,215,615,748.75 | 5,534,275,243.41  | 1.21 倍  | (4)  |
| 可供出售金融资产               | 26,483,424,940.30 | 16,160,875,630.78 | 63.87%  | (5)  |
| 应付短期融资款                | 11,039,500,000.00 | 5,528,760,000.00  | 99.67%  | (6)  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 10,109,468,691.68 | 1,668,996,284.93  | 5.06 倍  | (7)  |
| 代理买卖证券款                | 30,832,708,036.73 | 47,238,807,439.34 | -34.73% | (8)  |

(1) 货币资金项目期末数较期初数减少33.74%，主要系受行业景气度影响，客户资金减少所致。

(2) 结算备付金项目期末数较期初数减少31.82%，主要系受行业景气度影响，客户资金减少所致。

(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产项目期末数较期初数增长40.42%，主要系公司增加了债券、基金投资规模所致。

(4) 买入返售金融资产项目期末数较期初数增长1.21倍，主要系股票质押式回购业务与债券回购业务规模增加所致。

(5) 可供出售金融资产项目期末数较期初数增加63.87%，主要系公司增加了债券、证券公司理财产品、信托计划以及股权投资等投资规模所致。

(6) 应付短期融资款项目期末数较期初数增长99.67%,主要系本期发行短期公司债与收益凭证所致。

(7) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债项目期末数较期初数增长5.06倍,主要系本期结构化产品份额变化所致。

(8) 代理买卖证券款项目期末数较期初减少34.73%,主要系受行业景气度影响,客户资金减少所致。

## 2. 利润表项目

| 项 目       | 本期数              | 上年同期数            | 变动幅度    | 变动原因 |
|-----------|------------------|------------------|---------|------|
| 手续费及佣金净收入 | 4,551,146,729.83 | 7,515,649,593.57 | -39.44% | (1)  |
| 投资收益      | 3,587,046,962.46 | 2,296,667,532.76 | 56.18%  | (2)  |
| 所得税费用     | 579,797,104.99   | 1,348,970,822.74 | -57.02% | (3)  |

(1) 手续费及佣金净收入本期数较上年同期数减少39.44%,主要系本期股市动荡行情低迷成交量减少,公司佣金收入减少所致。

(2) 投资收益本期数较上年同期数增长56.18%,主要系本期子公司处置可供出售金融资产与自营收益较好所致。

(3) 所得税费用本期数较上年同期数减少57.02%,主要系本期应税收入减少所致。

方正证券股份有限公司

二〇一七年三月三十日