

公司代码：601555

公司简称：东吴证券

# 东吴证券股份有限公司

## 2016 年年度报告

### 重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证年度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

#### 二、未出席董事情况

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

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

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

#### 五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司2016年度利润分配预案为：以公司2016年12月31日总股本30亿股为基数，向全体股东每10股派送现金红利1.5元（含税），共派送现金红利4.5亿元。

#### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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

#### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

**八、 是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？**

否

**九、 重大风险提示**

适用 不适用

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

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

**十、 其他**

适用 不适用

## 目录

第一节	释义.....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	4
第三节	公司业务概要.....	22
第四节	经营情况讨论与分析.....	24
第五节	重要事项.....	50
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	65
第七节	优先股相关情况.....	72
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	73
第九节	公司治理.....	83
第十节	公司债券相关情况.....	90
第十一节	财务报告.....	94
第十二节	备查文件目录.....	227
第十三节	证券公司信息披露.....	227

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

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

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

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

公司注册资本和净资本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	3,000,000,000	2,700,000,000
净资本	19,466,092,527.16	17,561,589,687.38

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

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

融资融券业务；代销金融产品业务。

公司的主要业务资格如下：

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

12、2010年5月28日，江苏证监局批准公司自营参与股指期货交易。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

22、2013年7月1日，上海证券交易所“上证会字（2013）73号”《关于确认东吴证券

股份有限公司股票质押式回购业务交易权限的通知》，核准公司开展股票质押式回购业务。

23、2013 年 11 月 8 日，公司提交的《投资管理人受托管理保险资金报告材料》获得中国保险监督管理委员会备案通知，公司可以开展受托管理保险资金业务。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

34、2016年11月3日，深圳证券交易所以“深证会[2016]326号”《关于同意开通国信证券等会员单位深港通下港股通业务交易权限的通知》，同意公司开通相关交易单元的深港通下港股通业务交易权限。

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

## 二、 联系人和联系方式

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

## 三、 基本情况简介

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

## 四、 信息披露及备置地点

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

## 五、 公司股票简况

公司股票简况			
股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码
A股	上海证券交易所	东吴证券	601555



## 六、公司其他情况

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

√适用 □不适用

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

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

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

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

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

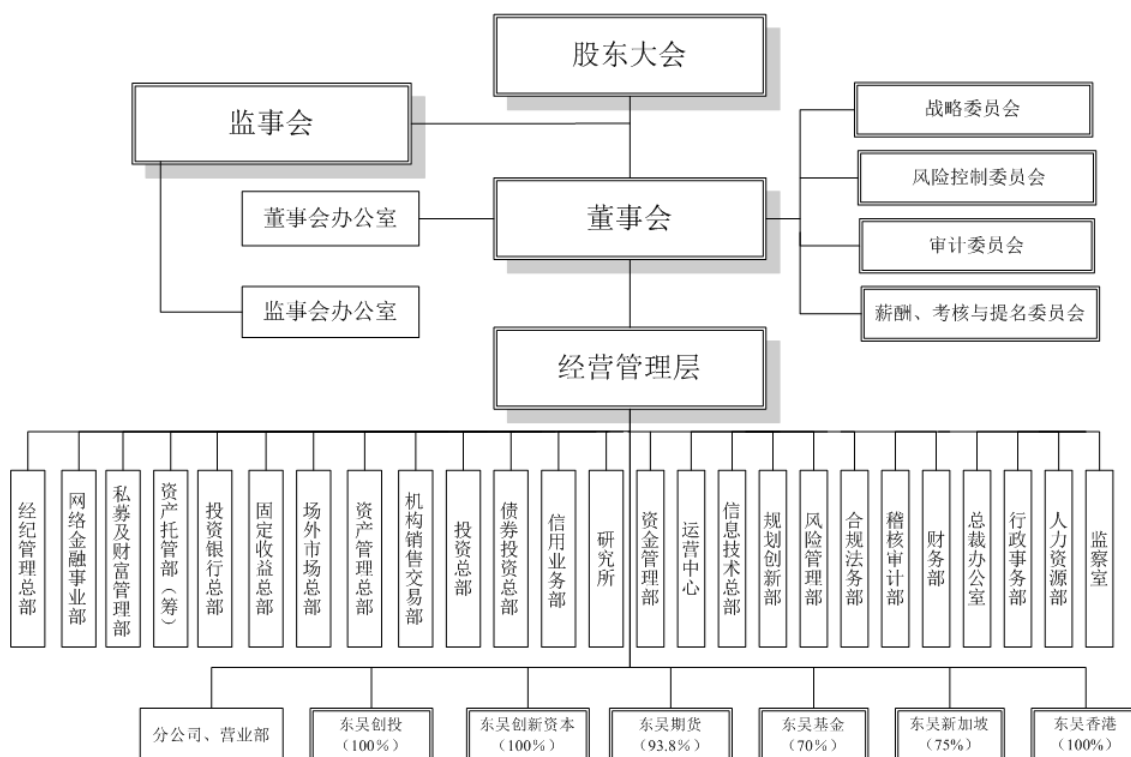
2014年2月13日，经中国证监会“证监许可[2014]200号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》核准，公司非公开发行不超过70,000万股新股。2014年8月5日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量7亿股，公司注册资本增加至27亿元，并于2014年8月12日完成了工商变更登记手续。

2015 年 12 月 23 日，经中国证监会“证监许可[2015]3035 号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》，核准公司非公开发行不超过 3 亿股（含 3 亿股）新股。2016 年 1 月 20 日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量为 3 亿股，公司注册资本增加至 30 亿元，并于 2016 年 2 月 5 日完成了工商变更登记手续，统一社会信用代码为 91320000137720519P。

## （二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

### 1、公司组织架构图



注：本公司还设有党委、党委办公室、纪委、工会和团委。

### 2、公司主要控股、参股公司情况

#### （1）东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 279 号

成立时间：2004 年 9 月

注册资本：人民币 10,000 万元

持股比例：70%

法定代表人：王炯

联系电话：021-5050 9888

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

### **(2) 东吴期货有限公司**

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 1208 号 6 楼

成立时间：1993 年 3 月

注册资本：人民币 50,000 万元

持股比例：93.80%

法定代表人：高海明

联系电话：021-6312 3019

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

### **(3) 东吴创业投资有限公司**

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2010 年 1 月

注册资本：人民币 120,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：冯玉泉

联系电话：0512-6293 8022

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

### **(4) 东吴创新资本管理有限责任公司**

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2012 年 6 月

注册资本：人民币 400,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：成军

联系电话：0512-6293 8925

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

#### (5) 东吴证券中新（新加坡）有限公司

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

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

成立时间：2015 年 8 月 28 日

注册资本：新加坡元 1,000 万元

持股比例：75%

董事长：刘辉

经营范围：资产管理及投资顾问业务

#### (6) 东吴证券（香港）金融控股有限公司

英文名称：SOOCHOW SECURITIES (HONG KONG) FINANCIAL HOLDINGS LIMITED

注册地址：RM 1202A 12/F WING ON HOUSE NO.71 DES VOEUX RD CENTRAL HONG KONG

成立时间：2016 年 6 月 27 日

注册资本：港币 10,000 万元

持股比例：100%

董事长：刘辉

### 3、公司设立分公司情况

截止报告期末，公司共设立 16 家分公司，具体情况见下表：

名称	公司地址	成立日期	营运资金 (单位：万元)	负责人	联系电话
吴江分公司	江苏省吴江市中山北路 172 号	2009.6.19	2000	刘先雁	0512-63427860
昆山分公司	江苏省昆山市前进中路 269 号	2009.6.22	2000	汪健	0512-57312926

张家港分公司	江苏省张家港市杨舍镇新风桥东堍	2009.6.22	2000	郭 淳	0512-58211473
常熟分公司	江苏省常熟市阜湖路 9 号	2009.6.23	2000	徐 明	0512-52705000
太仓分公司	江苏省太仓市城厢镇上海东路 6 号	2009.6.24	2000	董伟年	0512-53593539
北京分公司	北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 1003 室	2009.7.3	2500	刘 辉	010-66573700
上海分公司	上海市黄浦区西藏南路 1208 号 19-20 层	2009.7.10	2000	叶 犇	021-63122796
南京分公司	南京市中山南路 501 号江苏通服大厦 7 楼	2011.12.16	2000	杨 淮	025-83226660
常州分公司	常州市新北区通江中路 266 号	2013.6.26	2000	郑中巧	0519-88153791
无锡分公司	无锡市锡山区东亭街道东亭中路 20 号晶石国际中心 1601-1603 号	2013.7.4	2000	王振亚	0510-88229901
泰州分公司	江苏省泰州市海陵南路 360-6、360-7 号	2013.9.17	2000	秦国军	0523-86336333
徐州分公司	江苏省徐州市建国西路锦绣嘉园 8 号 1-1503~1506 室	2013.11.4	2000	周 洋	0516-66601555
南通分公司	江苏省南通市苏通科技产业园江成路 1088 号 8 号楼 8403 室	2013.11.4	2000	阮金阳	0513-55010310
深圳分公司	深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室	2013.12.9	2000	初 冬	0755-86561999
嘉兴分公司	嘉兴市花园路 886 号-A 室	2013.12.13	2000	郭家安	0573-82850255
福建分公司	福建省福州市鼓楼区五四路 19 号国泰大厦三楼 A 区	2015.11.26	2000	吴智俊	0591-87502720

### (三) 公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用

截止报告期末，公司共有营业部 121 家，其中 A 类 29 家，B 类 18 家，C 类 74 家，具体情况见下表：

序号	名称	地区	负责人
1	苏州西北街证券营业部	江苏省	叶晓晖
2	苏州广济北路证券营业部		朱淳亚
3	苏州角直迎宾路证券营业部		宗军荣
4	苏州工业园区蠡塘路证券营业部		仲钦
5	苏州工业园区东沙湖路证券营业部		曹新
6	苏州竹辉路证券营业部		苏文全
7	苏州通园路证券营业部		曾路
8	苏州虎池路证券营业部		施伟
9	苏州胥江路证券营业部		陈卫明

10	苏州东吴南路证券营业部	濮兆炜
11	苏州干将东路证券营业部	李庆宇
12	苏州工业园区敦煌路证券营业部	孙禹言
13	苏州狮山路证券营业部	江帆
14	苏州望亭镇牡丹路证券营业部	王博
15	苏州长江路证券营业部	薛佳
16	苏州浒关镇文昌路证券营业部	余雪敏
17	苏州滨河路证券营业部	顾文博
18	苏州虎丘区科技城证券营业部	张吴月
19	苏州工业园区现代大道证券营业部	崔檬
20	苏州工业园区胜浦证券营业部	顾志敏
21	苏州工业园区唯华路证券营业部	王校
22	苏州星湖街证券营业部	朱飏
23	苏州石路证券营业部	倪伟
24	苏州浒关镇证券营业部	陆冰
25	苏州工业园区仁爱路证券营业部	于梦瑶
26	苏州相城采莲路证券营业部	王南雁
27	苏州相城黄埭中市路证券营业部	严奕
28	苏州相城太平证券营业部	滕亮华
29	苏州吴中区木渎镇证券营业部	王跃建
30	苏州宝带东路证券营业部	朱亮
31	苏州吴中大道证券营业部	戴震凯
32	苏州胥口孙武路证券营业部	张志超
33	太仓上海东路证券营业部	林玲
34	太仓港经济技术开发区浮桥证券营业部	陆红益
35	太仓人民南路证券营业部	赵洪
36	太仓浏河镇证券营业部	戴伟
37	太仓沙溪镇白云中路证券营业部	顾卫东
38	太仓东盛广场证券营业部	沈国强
39	张家港杨舍证券营业部	管春鸣
40	张家港杨舍镇沙洲中路证券营业部	许冬
41	张家港塘桥镇证券营业部	汤伟
42	张家港锦丰镇证券营业部	苏张
43	张家港金港镇证券营业部	蒋剑青
44	昆山前进中路证券营业部	印磊
45	昆山陆家镇童泾路证券营业部	季清
46	昆山周市镇萧林东路证券营业部	王向阳
47	昆山张浦证券营业部	张勇
48	昆山花桥证券营业部	莫雪岗
49	昆山环城北路证券营业部	王伟明
50	昆山高新区前进西路证券营业部	朱剑
51	昆山千灯证券营业部	徐仁森
52	常熟阜湖路证券营业部	张文华

53	常熟商城中路证券营业部		周金根
54	常熟海虞镇证券营业部		张翊
55	常熟碧溪新区证券营业部		宗玲芳
56	常熟梅李镇证券营业部		王洁
57	吴江中山北路证券营业部		唐征东
58	吴江汾湖证券营业部		陈健
59	吴江鲈乡南路证券营业部		周林凤
60	吴江平望证券营业部		卢建明
61	吴江七都证券营业部		倪春华
62	吴江盛泽镇西环路证券营业部		顾雁飞
63	吴江震泽证券营业部		庄胜祥
64	吴江盛泽镇强武路证券营业部		钮建冬
65	南京中山南路证券营业部		李斌
66	南京江东北路证券营业部		卞爱亮
67	常州通江中路证券营业部		蒋幸福
68	常州常武中路证券营业部		徐永生
69	镇江解放路证券营业部		王永兴
70	扬中明珠大道证券营业部		庄志新
71	无锡东亭中路证券营业部		吕冠勋
72	无锡荡口鹅湖路证券营业部		郁天宇
73	江阴长江路证券营业部		蒋荣
74	宜兴解放东路证券营业部		卢黎鸣
75	徐州软件园证券营业部		赵艳
76	泰州海陵南路证券营业部		秦国军
77	姜堰人民中路证券营业部		赵非
78	仪征真州西路证券营业部		李友林
79	扬州徐凝门路证券营业部		刘海燕
80	盐城人民南路证券营业部		陈喆
81	淮安淮海南路证券营业部		张峰
82	南通崇川路证券营业部		朱修芳
83	无锡和风路证券营业部		何江萍
84	北京安德里北街证券营业部	北京市	张汉彬
85	北京亦庄证券营业部		姚勇
86	北京市陶然桥证券营业部		石少杰
87	上海西藏南路证券营业部	上海市	孙捷
88	上海奉贤环城东路证券营业部		吕威
89	上海浦东新区杨高南路证券营业部		程昂
90	深圳龟山路证券营业部	广东省	李洪全
91	东莞鸿福路证券营业部		江楠
92	东莞大朗证券营业部		周沃权
93	中山小榄民安南路证券营业部		郭嵘
94	东莞虎门证券营业部		李晖
95	杭州文晖路证券营业部	浙江省	杨运

96	新昌鼓山西路证券营业部		王德中
97	宁波江南路证券营业部		管锋
98	义乌义东路证券营业部		刘冰
99	台州云西路证券营业部		江志林
100	嘉善体育南路证券营业部		潘魏
101	嘉善西塘镇证券营业部		杭国兴
102	嘉兴常秀街证券营业部		陈伟波
103	海宁海州西路证券营业部		张东亮
104	桐乡世纪大道证券营业部		李振炎
105	福州五四路证券营业部	福建省	宁文宾
106	沈阳滂江街证券营业部	辽宁省	杨德双
107	沈阳黄河南大街证券营业部		路鹏
108	营口辽河老街证券营业部		于睿
109	大连五一广场证券营业部		汤放
110	哈尔滨闽江路证券营业部	黑龙江省	秦伟
111	昆明春城路证券营业部	云南省	许波
112	昆明白云路证券营业部		么志博
113	瑞丽人民路证券营业部		熊辉
114	大理振兴街证券营业部		张晓宇
115	三亚凤凰路证券营业部	海南省	吴俊
116	海口丽晶路证券营业部		段万强
117	重庆聚贤岩广场证券营业部	重庆市	李宏
118	长沙人民中路证券营业部	湖南省	王海宇
119	合肥黄山路证券营业部	安徽省	锁永军
120	济南明湖东路证券营业部	山东省	杨晓冬
121	郑州商务内环路证券营业部	河南省	鲍晓宾

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	南京市建邺区江东中路 106 号万达商务楼 B 座 19 楼
	签字会计师姓名	谈建忠、陆德忠
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	西部证券股份有限公司
	办公地址	西安东新街 232 号陕西信托大厦 7 层
	签字的保荐代表人姓名	张亮、滕晶
	持续督导的期间	2016. 1. 20-2017. 12. 31

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

### （一）主要会计数据

单位：元 币种：人民币



主要会计数据	2016年	2015年	本期比上年同期增减(%)	2014年
营业收入	4,645,225,993.82	6,830,161,925.32	-31.99	3,240,982,527.87
归属于母公司股东的净利润	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88	-44.68	1,115,452,050.88
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,484,123,247.13	2,698,193,970.77	-45.00	952,793,505.61
经营活动产生的现金流量净额	-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99	-	1,006,467,334.46
其他综合收益	-409,702,768.09	90,185,067.40	-554.29	255,447,836.03
	2016年末	2015年末	本期末比上年同期末增减(%)	2014年末
资产总额	89,476,701,728.74	80,589,136,533.56	11.03	57,461,111,012.63
负债总额	68,987,482,764.44	63,836,767,667.55	8.07	43,227,729,598.61
归属于母公司股东的权益	20,227,169,545.73	16,539,917,099.39	22.29	14,078,857,196.50
所有者权益总额	20,489,218,964.30	16,752,368,866.01	22.31	14,233,381,414.02

## (二) 主要财务指标

主要财务指标	2016年	2015年	本期比上年同期增减(%)	2014年
基本每股收益(元/股)	0.50	1.00	-50.00	0.49
稀释每股收益(元/股)	0.50	1.00	-50.00	0.49
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.50	1.00	-50.00	0.42
加权平均净资产收益率(%)	7.58	17.69	减少10.11个百分点	10.60
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	7.50	17.62	减少10.12个百分点	9.05

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

净资产收益率和每股收益按照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第9号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010年修订)的规定计算,计算过程详见财务报表附注补充资料中的16.02每股收益及净资产收益率。2016年1月20日,公司完成非公开发行股票事宜,发行数量3亿股,总股本由27亿股变更为30亿股。上表计算报告期每股收益时按照增发后的股数进行了计算,具体详见财务报表附注5.51。

## (三) 母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	19,466,092,527.16	17,561,589,687.38
净资产	19,794,490,089.42	16,238,764,267.81
风险覆盖率(%)	227.04	236.62
资本杠杆率(%)	27.32	24.07
流动性覆盖率(%)	250.73	217.85
净稳定资金率(%)	149.92	157.05
净资本/净资产(%)	98.34	108.15
净资本/负债(%)	60.89	55.46

净资产/负债(%)	61.91	51.29
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本(%)	30.52	42.36
自营非权益类证券及其衍生品/ 净资本(%)	106.43	100.36
融资(含融券)的金额/净资本(%)	79.34	80.64

注：上年度末的净资本及相关比例已根据《证券公司风险控制指标管理办法》(2016年修订版)进行重述。

## 九、境内外会计准则下会计数据差异

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

适用 不适用

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

适用 不适用

### (三) 境内外会计准则差异的说明：

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

	第一季度 (1-3月份)	第二季度 (4-6月份)	第三季度 (7-9月份)	第四季度 (10-12月份)
营业收入	1,027,793,756.10	800,773,705.41	1,499,307,127.05	1,317,351,405.26
归属于上市公司股东的净利润	342,270,297.90	272,017,845.67	635,417,607.68	248,582,755.13
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	343,933,955.44	270,526,023.28	627,429,619.99	242,233,648.42
经营活动产生的现金流量净额	-2,513,339,630.00	-254,661,471.02	-5,091,337,788.57	1,672,740,944.89

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

## 十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	2016年金额	附注(如)	2015年金额	2014年金额
----------	---------	-------	---------	---------

		适用)		
非流动资产处置损益	-379,668.78		-1,507,762.21	2,731,972.18
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	25,933,136.96		18,492,164.47	16,974,400.00
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-5,077,130.89		-2,104,598.68	-1,516,242.00
其他符合非经常性损益定义的损益项目				149,177,980.96
少数股东权益影响额	-1,191,993.72		-858,921.57	-162,033.32
所得税影响额	-5,119,084.32		-3,719,950.90	-4,547,532.55
合计	14,165,259.25		10,300,931.11	162,658,545.27

## 十二、 采用公允价值计量的项目

√适用 □不适用

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	14,222,827,510.80	21,769,705,706.86	7,546,878,196.06	347,541,906.38
可供出售金融资产	13,474,446,385.59	12,618,931,640.82	-855,514,744.77	504,990,587.49
衍生金融工具	-5,701,352.15	6,628,019.25	12,329,371.40	15,407,795.61
合计	27,691,572,544.24	34,395,265,366.93	6,703,692,822.69	867,940,289.48

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

### （一）合并财务报表数据

单位：元 币种：人民币

项目名称	2016 年末	2015 年末	增减百分比 (%)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,769,705,706.86	14,222,827,510.80	53.06
衍生金融资产	6,996,544.22	3,620.00	193,174.70
买入返售金融资产	16,980,151,202.32	8,923,142,748.05	90.29
应收款项	218,050,440.76	333,743,476.04	-34.67
应收利息	743,269,682.21	357,047,813.24	108.17
持有至到期投资	9,608,843.81	45,804,161.79	-79.02
长期股权投资	496,404,077.84	122,232,522.20	306.11
递延所得税资产	418,351,931.49	167,302,236.93	150.06

其他资产	236,753,431.22	698,598,724.37	-66.11
短期借款	180,964,512.50	93,684,509.36	93.16
拆入资金	0.00	350,000,000.00	-100.00
衍生金融负债	368,524.97	5,704,972.15	-93.54
应付职工薪酬	1,037,471,447.61	1,505,489,727.11	-31.09
应交税费	205,903,486.46	401,483,551.42	-48.71
应付款项	310,597,096.49	70,405,540.42	341.15
递延所得税负债	22,006,180.74	9,617,062.63	128.82
其他负债	14,909,393,126.03	6,877,015,079.34	116.80
资本公积	11,764,002,886.47	8,564,676,213.93	37.35
其他综合收益	-65,093,242.78	345,269,489.80	-118.85

项目名称	2016 年度	2015 年度	增减百分比 (%)
营业收入	4,645,225,993.82	6,830,161,925.32	-31.99
其中：经纪业务手续费净收入	1,300,163,518.11	2,646,254,123.37	-50.87
利息净收入	192,269,897.05	286,555,551.49	-32.90
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	19,095,206.51	2,643,966.52	622.22
公允价值变动收益	-495,181,738.10	306,628,570.68	-261.49
汇兑收益	2,675,446.69	1,162,645.34	130.12
其他业务收入	413,232,477.48	30,229,247.33	1,267.00
税金及附加	122,778,192.27	414,691,579.49	-70.39
业务及管理费	1,831,121,366.35	2,656,099,023.42	-31.06
资产减值损失	350,764,099.81	22,797,025.87	1,438.64
其他业务成本	402,896,451.27	12,433,685.30	3,140.36
营业利润	1,937,665,884.12	3,724,140,611.24	-47.97
加：营业外收入	67,541,665.33	18,900,229.51	257.36
减：营业外支出	5,975,272.47	85,774,425.93	-93.03
利润总额	1,999,232,276.98	3,657,266,414.82	-45.34
减：所得税费用	481,386,540.90	923,973,390.23	-47.90
净利润	1,517,845,736.08	2,733,293,024.59	-44.47
其中：归属于母公司股东的净利润	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88	-44.68
其他综合收益的税后净额	-409,702,768.09	90,185,067.40	-554.29
归属于母公司所有者的其他综合收益税后净额	-410,362,732.58	90,065,001.01	-555.63
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	659,964.49	120,066.39	449.67
综合收益总额	1,108,142,967.99	2,823,478,091.99	-60.75
归属于母公司所有者的综合收益总额	1,087,925,773.80	2,798,559,902.89	-61.13

## (二) 母公司财务报表数据

单位：元 币种：人民币

项目名称	2016 年末	2015 年末	增减百分比 (%)
衍生金融资产	6,996,544.22	3,620.00	193,174.70
买入返售金融资产	9,995,138,683.86	3,939,971,198.05	153.69
应收款项	116,601,445.75	248,448,188.51	-53.07
应收利息	434,212,649.49	220,941,972.04	96.53
存出保证金	113,708,503.30	442,192,492.84	-74.29
递延所得税资产	358,245,714.50	159,744,426.74	124.26
拆入资金	0.00	350,000,000.00	-100.00
应付职工薪酬	926,234,638.77	1,413,860,035.04	-34.49
应交税费	171,067,116.65	377,690,536.76	-54.71
预计负债	517,450.00	1,004,000.00	-48.46
资本公积	11,656,642,848.19	8,563,640,848.19	36.12
其他综合收益	-13,832,138.17	410,093,725.87	-103.37

项目名称	2016 年度	2015 年度	增减百分比 (%)
营业收入	3,581,367,433.38	6,282,781,739.63	-43.00
手续费及佣金净收入	2,360,710,862.88	3,627,018,864.30	-34.91
其中：经纪业务手续费净收入	1,145,925,438.59	2,577,600,916.69	-55.54
投资收益	1,374,472,861.06	2,114,401,606.17	-34.99
公允价值变动收益	-397,980,366.71	251,315,092.33	-258.36
汇兑收益	1,714,260.88	1,162,645.34	47.44
其他业务收入	8,137,080.64	4,992,775.11	62.98
营业支出	1,707,439,196.36	2,736,566,684.83	-37.61
税金及附加	112,306,052.20	385,952,277.72	-70.90
业务及管理费	1,268,319,044.35	2,327,817,381.24	-45.51
资产减值损失	326,814,099.81	22,797,025.87	1,333.58
营业利润	1,873,928,237.02	3,546,215,054.80	-47.16
加：营业外收入	47,338,185.15	5,429,243.23	771.91
减：营业外支出	5,311,193.00	64,497,011.86	-91.77
利润总额	1,915,955,229.17	3,487,147,286.17	-45.06
减：所得税费用	429,305,543.52	828,465,213.27	-48.18
净利润	1,486,649,685.65	2,658,682,072.90	-44.08
其他综合收益的税后净额	-423,925,864.04	109,760,404.23	-486.23
综合收益总额	1,062,723,821.61	2,768,442,477.13	-61.61

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### (一) 报告期内公司从事的主要业务及经营模式

公司从事的主要业务包括经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务。

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，通过互联网交易平台提供专业化研究和投资咨询服务，协助投资者作出投资决策，获取手续费、佣金及相关收入。

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板推荐、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务，获得承销费、保荐费、财务顾问费等相关收入。

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

资管及基金管理业务是根据资产规模及客户需求开发资产管理产品、基金产品及提供相关服务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务及基金管理业务，获取管理费、业绩报酬及其他收入。

信用交易业务主要包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务，获取利息及相关收入。

公司还通过东吴新加坡、东吴香港开展国际业务。东吴新加坡已获得新加坡金融管理局颁发资产管理业务牌照和投资顾问业务资格，报告期内获批 15 亿人民币合格境外机构投资者(RQFII)投资额度；东吴香港也在报告期内成立，将尽快获得香港《证券及期货条例》规管下的证券牌照业务，推动海外业务发展，加快公司国际化发展进程，优化公司证券控股集团战略布局。

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

根据国家金融助推供给侧改革的战略方向，中国资本市场也向着规范化、市场化、国际化的方向稳步前进，证券行业在服务实体经济、完善融资渠道、管理居民财富等方面肩负重要使命，具有较大的发展机遇。证券公司处于高速发展的时期，业务范围逐步扩大，收入水平与市场周期具有高度相关性，未来一段时期证券行业将呈现稳中有进的发展趋势。报告期内，监管部门对资

本市场依法从严监管，采取各种措施化解金融风险，降低杠杆，市场经历了年初的较大波动后逐步企稳，全年二级市场活跃度不高，沪深两市日均成交额同比大幅降低，受此影响证券行业总体经营规模和盈利能力下降明显。报告期内，公司创新转型、优化收入结构，总体市场地位继续稳步提升，公司主要业务排名有所提高。

## 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

报告期公司的资产变化情况详见第四节 二、（三）资产、负债情况分析。

其中：境外资产 128,922,135.92（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 0.14%。

## 三、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

### （一）以证券业务为基础，构建证券控股集团一体化平台优势

公司作为全业务牌照的综合类券商，子公司东吴基金、东吴期货、东吴创投、东吴创新资本在各自业务领域内深耕经营，与母公司在业务合作、资源对接、投研能力等方面联动合作和优势互补。同时，公司还参与发起设立苏州资产管理有限公司、拟收购东吴人寿部分股权，公司证券控股集团的优势逐步显现。

在巩固境内业务的同时，公司积极实施“走出去”战略，实现新加坡、香港等境外具有重要影响力的资本市场的业务布局。报告期内，香港子公司正式注册成立，东吴新加坡已获得新加坡金融管理局颁发资产管理业务牌照和投资顾问业务资格。

### （二）以长三角地区为依托，积聚优质客户群

公司地处长三角核心区域，地区各项经济指标处于全国领先水平。公司长期以来以长三角地区为依托，充分发挥区位优势，深耕细作，加速并优化区域布局，聚集优质客户群。经过多年的培育和发展，公司在长三角地区设立了一批盈利能力强、市场口碑好、客户忠诚度高的经营机构，积累了丰富的客户资源，树立了良好的品牌形象。截止报告期末，公司已在长三角地区设有 13 家分公司，96 家证券营业部，实现了区域、业务的全覆盖，形成了以长三角地区为“根据地”、辐射全国的网点布局。

### （三）以客户需求为导向，打造全方位全产业链服务能力

公司推动分公司“小型券商”化，推进组织架构创新转型，重构形成经纪业务线、证券投资线、投资银行线、资产管理线、证券金融线等业务线；推动公司大运营集中化管理，提升运营支撑能力，与国际领先的专业咨询机构合作，从中台切入，从流程、管理以及 IT 等各方面构建大运营体系，提升客户响应速度。通过组织架构重塑，公司的客户综合服务能力、运营支撑能力显著提升，连通客户的投融资需求，针对地方政府、上市公司、金融机构和中小企业、个人投资者等在内的客户需求，打造从场内到场外、从股权到债权、从公募到私募的产品体系，实现抢抓地方客户、服务实体经济发展、满足居民理财需求的目标。

#### （四）以金融科技为手段，推动公司数字化转型

公司持续加大在信息科技领域的投资力度，不断完善信息技术基础设施建设，以自主研发、业务外包、技术合作等方式提升公司的数据挖掘和大数据应用能力，以科技创新推动传统业务转型。公司成立数字支撑部门，建设大数据平台和数据仓库，积极构建数据管控、主数据管理、数据质量、数据集成、数据架构和数据安全六大关键能力，推进运营流程管理系统（BPM）建设。

#### （五）以企业文化为纽带，保障公司健康持续发展

在源远流长、底蕴深厚的“吴文化”浸润下，公司在多年的经营发展过程中形成了独具特色的企业文化，包括审慎稳健的合规文化、以人为本的家园文化、锐意进取的创新文化。公司注重文化培育引导，加强管理与文化的融合，“诚信、稳健、务实、笃行”已成为根植于公司管理体系的文化基因。

尤其是近年来，风险控制和合规管理文化是公司企业文化建设的重要内容，公司始终坚持风险管理的红线标准和底线原则，全面落实“三个监管”的具体要求，公司建立了完善的风险管理组织架构、全面风险管理体系以及流动性风险应对机制、常态化的监督检查机制、有效的激励和问责机制，实现了风险合规管理与业务发展的统筹兼顾和动态均衡。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2016 年，中国经济面对增长内生动力不足，部分行业产能过剩等问题，通过推进供给侧改革，保持了平稳健康发展。经济结构继续优化，质量和效益提高；创新对发展的支撑作用增强；发展新动能不断显现；改革开放取得新突破，对外开放布局进一步完善；经济运行保持在合理区间，实现了“十三五”良好开局。



2016年，国内资本市场在“依法监管、从严监管、全面监管”的理念下，坚持市场化、法治化、国际化的改革方向，呈现稳中有进、稳中有新的特点，多层次资本市场体系日趋完善，对实体经济特别是供给侧改革的支持力度不断增强。2016年，二级市场在经历年初较大波动后，呈现震荡企稳的格局。2016年全年上证综指下跌12.31%，深证成指下跌19.65%，根据WIND资讯统计，沪深两市股票日均成交额为5,184.95亿元，同比下降50%。

面对机遇和挑战并存的市场形势，公司加快创新转型、优化管理机制、布局国际业务、有效推进证券控股集团建设。报告期内，公司顺利完成股票非公开发行工作，资本实力进一步增强，有效支撑公司各项业务的发展。公司积极创新，抢抓先行先试机遇，成功发行全国首批创新创业公司债券，联手大型央企成功设立规模达100亿元的国寿东吴（苏州）城市发展基金。国际业务方面，香港子公司获批成立，新加坡子公司已获得新加坡金融管理局颁发资产管理业务牌照和投资顾问业务资格以及中国证监会核准的RQFII资格。此外，公司参与发起设立了苏州资产管理有限公司，并达成入股东吴人寿意向，证券控股集团的版图更加清晰。

## 二、报告期内主要经营情况

2016年，在行业整体业绩较大幅度下滑的环境下，公司努力拓展各项业务，市场份额稳步提升，公司主要业务指标优于行业平均水平，全年实现营业收入46.45亿元，同比下降31.99%；利润总额19.99亿元，同比下降45.34%；归属于上市公司股东的净利润14.98亿元，同比下降44.68%；基本每股收益0.50元/股，同比下降50%。在2016年证券公司分类监管评级中，公司获得A类A级券商评级。

### （一） 主营业务分析

#### 利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例（%）
营业收入	4,645,225,993.82	6,830,161,925.32	-31.99
营业成本	2,707,560,109.70	3,106,021,314.08	-12.83
经营活动产生的现金流量净额	-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99	-
投资活动产生的现金流量净额	-407,597,065.55	-261,507,863.61	-
筹资活动产生的现金流量净额	2,382,875,828.75	14,194,144,284.80	-83.21
研发支出	36,140,104.54	17,966,374.99	101.15

## 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

公司实现营业收入 46.45 亿元，同比下降 31.99%，主要是因为：经纪及财富管理业务收入同比下降 45.63%；投资与交易业务业务收入同比下降 41.37%；信用交易业务收入同比下降 23.91%。

公司营业成本 27.08 亿元，同比下降 12.83%，主要是因为业务及管理费、税金及附加同比下降。

## (1). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
经纪及财富管理业务	1,645,292,106.25	729,772,377.55	55.64	-45.63	-35.14	减少 7.17 个百分点
投资银行业务	896,114,520.17	448,737,684.12	49.92	11.10	-4.23	增加 8.01 个百分点
投资与交易业务	1,042,754,119.66	884,600,294.62	15.17	-41.37	160.80	减少 64.48 个百分点
资管及基金管理业务	441,782,162.71	309,514,686.46	29.94	2.69	1.19	增加 1.04 个百分点
信用交易业务	529,342,353.98	48,781,645.47	90.78	-23.91	-71.30	增加 11.94 个百分点
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
江苏省内	1,206,255,598.68	503,613,244.62	58.25	-50.59	-35.37	减少 9.83 个百分点
江苏省外	226,646,412.40	111,662,651.56	50.73	-53.66	-42.81	减少 9.34 个百分点
总部及子公司	3,212,323,982.74	2,092,284,213.52	34.87	-17.63	-1.84	减少 10.48 个百分点

合计	4,645,225,993.82	2,707,560,109.70	41.71	-31.99	-12.83	减少 12.81 个 百分点
----	------------------	------------------	-------	--------	--------	----------------------

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

√适用 □不适用

①经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，通过提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。报告期内，公司经纪及财富管理业务实现营业收入 16.45 亿元，同比下降 45.63%。

报告期内，沪深两市股票成交量大幅下滑，公司经纪及财富管理业务加速创新转型，探索差异化的业务模式，积极推进网络金融，拓展综合金融，以提升市场份额为目标，切实加强渠道建设，线上线下齐头并进，强化客户拓展，个人客户、企业客户、机构客户全面推进，市场份额实现有效提升。报告期内，公司经纪业务客户数量增长 14.02 万户，市场占有率从 1.047% 上升为 1.169%。全年代理买卖业务成交量（A 股+基金）32,351 亿，同比下降 43%。

报告期内，公司分公司转型取得成效，充分依托地缘优势，开展综合金融业务。公司持续推动 IB、个股期权、港股通等业务发展，其中深港通业务顺利上线并正常运行。报告期内，公司持续推进网点建设，优化网点布局，提升经纪业务网络服务效率，共获批新设营业部 29 家，完成 20 家营业部的筹建工作，9 家营业部的迁址工作，截至目前，公司拥有 16 家分公司，130 营业部（含筹建）。

公司积极发展网络金融，加快线下线上融合，继续提升经纪条线客户业务处理线上化工作，提升客户线上服务，提升客户绑定率，提高客户活跃度，打造顺畅的客户服务渠道。公司利用东吴秀财交易平台各项功能，为客户提供开户、二次业务办理、资讯服务推送、理财产品推介等各类增值服务，增加客户黏度，提高服务效率。

报告期内，公司在证券时报举办的“2016 中国最佳财富管理机构评选”中获得“2016 中国最具突破证券经纪商”、中国证券投资者保护基金公司评选的“2016 年度投资者调查优秀证券公司”荣誉称号；在财富苏州金融创新价值榜评选活动中，东吴秀财交易平台获得苏州银行业协会和苏州市金融学会颁发的“金融服务创新奖”。

代理买卖证券情况：

单位：亿元 币种：人民币

项目	2016 年		2015 年度	
	交易金额	市场份额	交易金额	市场份额
A 股	31,377.31	1.233%	54,340.6	1.067%
B 股	25.66	0.863%	62.8	0.849%
基金	973.88	0.437%	2,206.51	0.723%
其他	8,788.87	0.184%	8,419.53	0.320%
合计	41,165.72	0.546%	65,029.44	0.809%

代理销售金融产品情况：

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期金额		上期金额	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	2,461,660,370.42	5,474,031.00	4,375,388,805.42	5,780,225.80
资产管理计划	48,568,431,982.22	10,743,430.19	64,367,588,850.93	5,483,093.99
合计	51,030,092,352.64	16,217,461.19	68,742,977,656.35	11,263,319.79

公司通过控股子公司东吴期货有限公司开展期货经纪业务。报告期内，东吴期货深耕市场、狠抓机遇，紧紧围绕提升客户服务能力，全面推进创新业务转型升级，服务能力显著提高，盈利能力不断增强。报告期内，东吴期货在《期货日报》、《证券时报》联合主办的 2016 年第九届最佳期货分析师评选中荣获“中国最具成长性期货公司”称号、下属子公司——上海东吴玖盈投资管理有限公司荣获“最佳风险管理子公司服务奖”、东吴期货研究所荣获“中国金牌期货研究所”称号，资管产品“对冲套利——火车头三号”获“年度优秀期货资产管理产品”奖。报告期内，东吴期货实现营业收入 6.23 亿元，实现利润总额 0.50 亿元。

## ②投资银行业务

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板业务、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务等业务。报告期内，公司投资银行业务实现收入 8.96 亿元，同比增长 11.10%。

报告期内，公司以产业链整合为纽带，围绕核心客户，实现资本中介业务跨越式突破，在做稳传统业务的同时，充分整合公司内外部资源，发挥专业能力，拓展多样化的业务模式，围绕核心客户，打造全产业、全方位价值链。公司与常熟、昆山、张家港、吴江、太仓以及徐州、无锡高新区、贵州铜仁等地政府签约，全面深化与各地的战略合作关系；加强与其他券商、银行、保险、基金等金融机构的业务合作，在 IPO、再融资、公司债、新三板、产业基金等多种业务模块上实现新的突破。

股权融资业务围绕核心客户打造全产业、全方位价值链。公司 IPO 项目全年过会 2 单，其中张家港农商行股份有限公司首发项目已于 2017 年 1 月成功发行；完成二三四五、赢时胜等再融资 11 单，募集资金规模 141.87 亿元；完成东北证券配股项目，募集资金 34.80 亿元；完成千足珍珠并购重组项目。

债券融资业务围绕政府和企业债务结构调整，做大做强固收业务。公司全年完成 16 迪马，16 金智债 2 单上市公司债券；16 如东收益债等 10 单企业债券；16 锡惠开等 34 单非上市公司债券；资产证券化产品 3 单，公司全年合计完成债券发行 49 单，项目融资额 501.47 亿元。报告期内，公司还积极推进固收业务产品创新，成功发行全国首批创新创业公司债券，为实现创新创业企业通过债券市场筹集资金进行了探索实践；公司承销的 16 邵东专项债是全国首单双创孵化企业债，如东棚改项目债是全国首单获批的棚户区改造项目收益债券；公司还成功发行了交易所市场规模最大的公积金 ABS 产品——苏州公积金资产证券化项目。此外，公司还紧跟政策导向和市场步伐，积极开展绿色债券、可交换债、双创可转债、PPP 项目 ABS 和熊猫债等产品创新试点。

新三板业务围绕扶持中小企业巩固新三板业务优势，致力于为中小企业提供挂牌、融资、做市、行业研究、转板及并购重组等全产业链服务。公司新三板挂牌业务牢牢占据行业第一方阵，价值发现能力位于主办券商前列。2016 年，公司全年成功挂牌项目 162 家，年度挂牌数量从去年的行业第 9 名上升至第 5 名；累计挂牌数达 310 家，累计挂牌数由去年的第 10 名上升至第 6 名；全年在股转系统完成 76 单定向发行，融资金额 23.87 亿元；新增做市 84 家，做市总数累计 164 家。公司新三板业务以企业挂牌作为起点，在企业登陆新三板后的成长周期，以企业需求为导向，重点发展“挂牌后服务”，提供精细化、专业化的持续督导服务；积极协助优质企业以并购重组为手段，整合优势资源；依托东吴证券大投行架构，为挂牌企业转板打下坚实基础。

报告期内，公司获得上海证券交易所“创新创业公司债券优秀参与奖”、证券时报“2016 中国区股转系统最佳主办券商”、新三板在线“2016 年度十大品牌券商”、《价值线》等媒体发布的“第三届中国城市资本竞争力暨 A 股上市公司未来价值排行榜”“2016 中国最佳成长投行”等荣誉。

单位：万元 币种：人民币

项目		2016 年	2015 年
IPO	承销金额	0	128,379.79
	保荐及主承销收入	1,686.79	9,647.07
再融资	承销金额	1,712,134.47	957,849.67
	保荐及主承销收入	26,453.91	10,072.68
债券	承销金额	4,141,000	3,066,666.67
	主承销收入	30,688.31	28,426.875

### ③投资与交易业务

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。报告期内，公司投资与交易业务共实现业务收入 10.43 亿元，同比减少 41.37%。

在权益性证券方面，公司始终坚守本金投资，追求绝对收益；坚持价值投资的理念、采取稳健经营的策略，严格投资流程管理，严控系统性风险；通过重点投资和组合投资相结合的方式，加强研究跟踪，发现投资机会，采用多种投资手段，进行多元化资产配置。同时，公司加大低风险投资力度，积极参与新股询价申购、非公开发行股票报价投资、可交换债券投资以及多元现金管理，提升收益贡献。此外，公司不断完善交易系统和交易策略，有效提升了系统效率和风控水平。

在固定收益证券方面，公司通过前瞻性的市场判断，采取相对稳健的防御性投资策略，以大类资产配置和风险对冲管理为主，同时加强市场风险管理和投研能力建设，大力发展资本中介业务，积极配置私募可交换债等新兴类固收品种，实现投资管理业务的多元化布局。

公司通过全资子公司东吴创新资本开展另类投资业务。报告期内，东吴创新资本通过合理的资金安排，对接低风险的类固定收益金融产品，同时大力发展资本中介业务，回避二级市场波动。东吴创新资本积极主动探索各类创新业务，有效发挥了对冲投资平台、非标投资平台、创新型金融产品投资平台等诸多平台功能，为公司开展综合金融业务、集团化发展战略拓展了空间。报告期内，东吴创新资本实现利润总额 7,301.40 万元，净利润 5,866.17 万元。

公司通过全资子公司东吴创投开展直接投资业务。东吴创投努力扩大整体规模、提升投资能力，适应整体经济形势、创建新型业务模式。在报告期内，通过不断地与多地政府、实力机构和大客户开展实质性合作，实现优势互补，参与或搭建新型的、灵活的投资平台，使投资项目的资金来源得到有力地保障，为公司未来的业务拓展寻找新的增长点和突破口。东吴创投全年实现利润总额 17,099.34 万元，净利润 14,220.61 万元。

### ④资管及基金管理业务

资管及基金管理业务是根据资产规模及客户需求开发资产管理产品、基金产品及提供相关服务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务及基金管理业务。报告期内，公司资管及基金管理业务共实现业务收入 4.42 亿元，同比增长 2.69%。

公司资产管理业务积极谋求转型升级，加强核心竞争能力建设，资产管理规模不断扩大，资管综合平台优势更加显著。公司结合资产管理业务整合和转型要求，优化组织结构，加大人才引进力度，提升产品管理能力，做大做强主动管理产品，推进创新业务和特色业务，产品和收入结构更加合理。报告期内，资管条线首只量化对冲产品、货币基金产品落地，首只资产证券化产品顺利发行。嘉兴天然气 ABS 项目在证券时报举办的财富管理机构评选中，荣获“2016 十大创新资管产品”荣誉。截至报告期末，公司定向业务规模 2,516.42 亿元，资产管理业务受托管理资产日均规模 2,498 亿元，同比增长 47.81%，年末受托管理总规模为 2,756.42 亿元，同比增长 34.46%。

公司通过控股子公司东吴基金开展基金管理业务。报告期内，东吴基金继续致力于多元化发展战略，各项产品线日臻完善，公募、专户、子公司三业并举，产品线覆盖股票、债券、平台融资类资管计划等多个领域，多元经营格局稳步推进。截至报告期末，东吴基金管理的资产总规模达 631.46 亿元，其中公募基金规模 148.47 亿元，专户资产规模 101.51 亿元，子公司专项资产规模 381.48 亿元。全年实现营业收入 23,282.20 万元，利润总额 3,745.01 万元。

#### ⑤信用交易业务

信用交易业务主要为个人及机构客户提供包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等资本中介业务。报告期内，公司信用交易业务实现营业收入 5.29 亿元，同比下降 23.91%。

报告期内，信用交易业务市场经营环境日益严峻，沪深两市融资融券余额增长乏力。公司信用业务部门积极推进业务转型，夯实两融业务基础，优化业务规模结构，大力推进机构客户，提升机构客户融资余额占比。同时，利用行情低迷、市场估值低、股票质押业务安全系数较高的市场环境，大力发展股票质押业务，公司股票质押业务呈现逆势增长态势，摆脱单纯依靠融资融券业务的发展模式，收入结构更加均衡稳定。截至报告期末，公司信用交易业务总规模 359.01 亿元，同比增长 20.19%，其中融资融券业务规模 86.5 亿元，股票质押业务余额 271.25 亿元，约定购回式业务余额 1.26 亿元。

2017 年公司将继续推进信用业务转型发展，持续优化信用业务的收入结构，逐步树立“东吴信用”的品牌影响力，不断提升信用业务的竞争力，稳步提高信用业务市场份额。

#### ⑥证券研究业务

公司研究所成功转型卖方业务后，不断加强自身研究能力建设，持续推进研究团队建设，研究业务能力显著提升，在中国资本市场的卖方领域中初露头角，在业内建立了一定的品牌影响力

和市场知名度。研究所在 2016 年新财富评比中荣获进步最快研究机构第一名，非银金融团队荣获新财富第二名、金牛奖第一名；电力设备荣获新财富第二名，机械团队荣获新财富第四名、金牛奖第四名，食品饮料荣获新财富第五名，此外传媒、环保及北京区域销售团队均入围新财富评选。截至报告期末，研究所共有包括宏观、策略、行业、新三板等 15 个研究团队，市场热点行业配置已有明显增强。研究所将努力提高公司研究业务的品牌和影响力，加强对公司其他业务线的支持及合作。

#### ⑦新业务开展情况

互联网证券业务形成规模。公司以金融科技为导向，加大技术投入，完善线上业务办理能力和投顾功能，优化智能投顾和客户交易体验，打造投资社交平台。报告期内，东吴秀财 APP 下载用户数和日活跃用户均实现大幅增长，掌厅、单向视频开户系统、运营平台等产品上线并顺利运营。公司通过源代码级的集成开发，大大增强行情交易功能和优化用户体验；通过增强五牛组合投顾服务和量身定制智能投顾服务产品开发，显著提高公司投顾资讯服务水平；推进智能在线客服，提高客户服务效率。在 2016 年新浪券商 APP 测评榜单中，秀财 APP 进入安全类 TOP10。

加快推进主经纪商（PB）业务。公司抓住发展机遇，加快业务资格、人才队伍、信息系统、制度流程等 PB 业务基础环境的建设工作，并充分利用苏州当地产业扶持的政策条件和公司现有的资源条件，与商业银行、信托公司、基金公司等金融机构开展业务合作，提高自身在资源挖掘、整合及供给方面的水平和效率，提升公司 PB 业务的市场影响力和客户满意度，推进公司 PB 业务快速发展。报告期内，累计上线产品 124 只，累计成立规模 58.26 亿元，2016 年全年交易量（A 股+基金）470.86 亿元。

报告期内，公司启动大运营优化项目，向管理创新要效益。证券业务的综合化和规模化发展、创新产品与服务的支撑需求对运营能力建设提出了更高要求，为此，公司专门成立了大运营优化咨询项目领导小组，与国际领先的专业咨询机构合作，从中台切入，从流程、管理以及 IT 等各方面构建大运营体系，全面提升服务和运营支撑能力。

#### ⑧账户规范情况

公司持续落实、不断创新账户管理措施，进一步完善客户档案管理系统，持续做好客户档案实物和电子化管理工作；加强账户日常管理工作的严格要求；加强投资者身份信息的核查工作，通过资金账户与证券账户信息每周比对工作，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；除休眠账户、剩余不合格账户、司法冻结账户等被限制使用外，正常交易的账户均为合格账户，有效落实账户规范管理的各项工作。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司剩余不合格证券账户 151 户，不合格资金账户数 131 户；小额休眠证券账户 241,495 户，休眠资金账户数 131,419 户，纯资金账户 36,636 户；司法冻结资金账户数 17 户；我司无风险处置账户。

## (2). 产销量情况分析表

适用 不适用

## (3). 成本分析表

单位：元

分行业情况							
分行业	成本构成项目	本期金额	本期占总成本比例 (%)	上年同期金额	上年同期占总成本比例 (%)	本期金额较上年同期变动比例 (%)	情况说明
经纪及财富管理业务	业务及管理费、税金及附加	729,772,377.55	37.35	1,125,216,918.35	36.64	-35.14	报告期内，公司经营业绩有所下滑，相关费用和税金相应下降。
投资银行业务		448,737,684.12	22.97	468,563,237.90	15.26	-4.23	
投资与交易业务		135,132,893.58	6.92	326,756,826.93	10.64	-58.64	
资管及基金管理业务		309,514,686.46	15.84	305,870,536.21	9.96	1.19	
信用交易业务		44,588,495.43	2.28	147,196,596.05	4.79	-69.71	

## (4). 主要销售客户及主要供应商情况

适用 不适用

## 2. 费用

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	2016 年	2015 年	增减百分比 (%)
业务及管理费	1,831,121,366.35	2,656,099,023.42	-31.06
税金及附加	122,778,192.27	414,691,579.49	-70.39

### 3. 研发投入

#### 研发投入情况表

√适用 □不适用

单位：元

本期费用化研发投入	36,140,104.54
本期资本化研发投入	-
研发投入合计	36,140,104.54
研发投入总额占营业收入比例 (%)	0.78
公司研发人员的数量	62
研发人员数量占公司总人数的比例 (%)	2.3
研发投入资本化的比重 (%)	-

报告期内，公司致力于提升公司信息技术、改善客户服务体验，继续对加大对东吴证券秀财APP财富管理平台、秀财网财富管理平台、微信、QQ公众服务平台、掌上营业厅、综合运营管理平台、新一代千万级用户高并发交易系统研发投入，为支持公司创新业务提供技术支持，合计研发支出3,614.01万元。

### 4. 现金流

√适用 □不适用

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99	-
投资活动产生的现金流量净额	-407,597,065.55	-261,507,863.61	-
筹资活动产生的现金流量净额	2,382,875,828.75	14,194,144,284.80	-83.21

报告期内，公司现金及等价物净增加额为-42.03亿元。具体分析如下：

(1) 经营活动产生的现金净流出为61.87亿元，主要流入项目为：收取利息、手续费及佣金的现金52.33亿元，融出资金净减少额22.59亿元，收到其他与经营活动有关的现金净额89.45亿元；主要流出项目为：处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额65.86亿元，代理买卖证券支付的现金净额44.59亿元，支付利息、手续费及佣金的现金12.94亿元，拆入资金净减少额3.50亿元，回购业务资金净减少额59.75亿元，支付给职工以及为职工支付的现金13.49亿元，支付的各项税费10.68亿元，支付的其他与经营活动有关的现金15.42亿元。经营活动产生的现金流量净额比上年减少的主要原因是报告期内代理买卖证券支付的现金净额增加。

(2) 投资活动产生的现金净流出为 4.08 亿元，主要流入项目为收到其他与投资活动有关的现金 0.16 亿元；主要流出项目为：购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 1.53 亿元，为取得子公司及其他营业单位而支付的现金 2.70 亿元。投资活动产生的现金流量净额比上年减少的主要原因是取得子公司及其他营业单位支付的现金净额增加。

(3) 筹资活动产生的现金净流入 23.83 亿元，主要流入项目为：吸收投资收到的现金 34.59 亿元，取得借款收到的现金 1.60 亿元，发行债券收到的现金 81.80 亿元；收到其他与筹资活动有关的现金 1.91 亿元；主要流出项目为：偿还债务支付的现金 79.47 亿元，本期实际分配股利及偿付利息支付的现金 14.70 亿元，支付其他与筹资活动有关的现金 1.91 亿元。筹资活动产生的现金流量净额比上年减少的主要原因是公司报告期内发行债券收到的现金减少。

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

## (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

## (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,769,705,706.86	24.33	14,222,827,510.80	17.65	53.06	主要为期末持有的债券资产规模较年初增加所致
衍生金融资产	6,996,544.22	0.01	3,620.00	0.00	193,174.70	主要由于本期权益收益互换业务形成的衍生金融资产增加所致
买入返售金	16,980,151,202.32	18.98	8,923,142,748.05	11.07	90.29	股票质押回购业

融资产						务、债券质押回购业务和债券买断式回购业务规模大幅度增加所致
应收款项	218,050,440.76	0.24	333,743,476.04	0.41	-34.67	主要是本期公司收回广州博融投资有限公司的应收款项所致
应收利息	743,269,682.21	0.83	357,047,813.24	0.44	108.17	主要是应收债券投资利息增加所致
持有至到期投资	9,608,843.81	0.01	45,804,161.79	0.06	-79.02	主要是持有至到期的债券减少所致
长期股权投资	496,404,077.84	0.55	122,232,522.20	0.15	306.11	主要是由于公司本期增加了对联营企业的长期股权投资所致
递延所得税资产	418,351,931.49	0.47	167,302,236.93	0.21	150.06	可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	236,753,431.22	0.26	698,598,724.37	0.87	-66.11	主要是应收款项类投资减少所致
短期借款	180,964,512.50	0.20	93,684,509.36	0.12	93.16	主要由于本期东吴创新资本的信用借款增加所致
拆入资金	0.00		350,000,000.00	0.43	-100.00	主要由于本期归还拆入资金所致
衍生金融负债	368,524.97	0.00	5,704,972.15	0.01	-93.54	主要由于本期股票期权和权益收益互换业务形成的衍生金融负债减少所致
应付职工薪酬	1,037,471,447.61	1.16	1,505,489,727.11	1.87	-31.09	主要是由于本期末应付职工的工资、奖金、津贴和补贴减少所致
应交税费	205,903,486.46	0.23	401,483,551.42	0.50	-48.71	主要是由于本期应交营业税和企业所得税减少所致
应付款项	310,597,096.49	0.35	70,405,540.42	0.09	341.15	主要是应付清算款增加所致
递延所得税负债	22,006,180.74	0.02	9,617,062.63	0.01	128.82	应纳税暂时性差异增加所致
其他负债	14,909,393,126.03	16.66	6,877,015,079.34	8.53	116.80	主要是由于本期纳入合并范围的结构化主体中应付其他

						投资者的负债增加所致
资本公积	11,764,002,886.47	13.15	8,564,676,213.93	10.63	37.35	主要是本期公司定向增发新股,股本溢价增加所致
其他综合收益	-65,093,242.78	-0.07	345,269,489.80	0.43	-118.85	主要是可供出售金融资产公允价值变动所致

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

所有权或使用权受到限制的资产,具体参见财务报表附注“14.07 所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

## 3. 其他说明

适用 不适用

### (四) 行业经营性信息分析

详见主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

### (五) 投资状况分析

#### 1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末,本公司长期股权投资 4.96 亿元,与上年末相比增加 3.74 亿元,增幅为 306.11%,主要是联营企业东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司本期投资收益和其他权益变动及公司本期新增对联营企业苏州资产管理有限公司的投资所致。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

单位:元

本年度被投资公司名称	主要业务	出资额	持股比例	报告期投资收益	报告期公允价值变动
苏州资产管理有限公司	资产管理	240,000,000.00	20.00%	-63,443.91	不适用

#### (2) 重大的非股权投资

适用 不适用

**(3) 以公允价值计量的金融资产**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

会计科目	投资成本	年末账面余额	报告期内购入或出售净额	报告期投资收益	报告期公允价值变动
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,877,619,734.14	21,769,705,706.86	8,051,991,255.77	852,654,966.09	-505,113,059.71
衍生金融工具	不适用	6,628,019.25	不适用	5,476,474.00	9,931,321.61
可供出售金融资产	14,187,436,197.32	13,764,049,563.39	326,172,523.01	851,583,096.11	-553,675,812.45

**(六) 重大资产和股权出售**

□适用 √不适用

**(七) 主要控股参股公司分析**

√适用 □不适用

(1) 东吴基金管理有限公司，注册资本为1亿元人民币，公司持有70%的股权，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。截止2016年12月31日，东吴基金总资产4.16亿元，净资产3.39亿元，2016年实现营业收入23,282.20万元，利润总额3,745.01万元，净利润3,140.40万元。

(2) 东吴期货有限公司，注册资本为5亿元人民币，本公司持有93.8%的股权，其经营范围包括：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询、资产管理等业务。截止2016年12月31日，东吴期货总资产30.45亿元，净资产6.17亿元，2016年实现营业收入62,296.54万元，利润总额4,992.69万元，净利润3,656.83万元。

(3) 东吴创业投资有限公司，注册资本为12亿元人民币，为公司全资子公司，其经营范围包括：创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。截止2016年12月31日，东吴创投总资产10.76亿元，净资产10.38亿元，2016年实现利润总额17,099.34万元，净利润14,220.61万元。

(4) 东吴创新资本管理有限责任公司，注册资本为40亿元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：资产管理、投资管理，投资咨询；项目投资、实业投资、股权投资；贵金属、金属材料、食用农产品、化工原料及产品（不含危险化学品）销售。截止2016年12月31日，东吴创新资本总

资产26.14亿元，净资产17.33亿元，2016年实现利润总额7,301.40万元，净利润5,866.17万元。

(5) 东吴证券中新（新加坡）有限公司，注册资本为1000万新加坡元，为公司控股子公司，经营范围为：资产管理及投资顾问业务。截止2016年12月31日，东吴新加坡总资产0.43亿元，净资产0.42亿元，2016年实现营业收入0.02万元，利润总额-536.42万元，净利润-536.42万元。

(6) 东吴证券（香港）金融控股有限公司，注册资本1亿港元，为公司全资子公司。2016年6月12日，公司取得了中国证监会《关于核准东吴证券股份有限公司在香港特别行政区设立东吴证券（香港）金融控股有限公司的批复》（证监许可[2016]1266号），2016年6月27日，东吴香港在香港完成了注册手续。截止2016年12月31日，东吴香港总资产0.86亿元，净资产0.86亿元，2016年实现营业收入4.10万元，利润总额-337.44万元，净利润-337.44万元。

#### (八) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

本公司根据准则33号(2014)《企业会计准则第33号—合并财务报表》（修订），对于本公司作为管理人或投资人，且综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并，本期纳入公司合并报表范围的结构化产品共39只（其中有11只产品已于2016年度清算）。

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

截至2016年12月31日，合并资产管理计划的总资产为人民币19,964,334,465.88元。本公司持在上述合并资产管理计划中的权益体现在资产负债表中可供出售金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的总金额为人民币3,684,665,716.46元。

### 三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

#### (一) 行业格局和趋势

√适用 □不适用

2017年我国资本市场改革发展挑战和机遇并存。从证券行业发展环境来看，行业整体平稳发展，监管政策改革推进。证券行业内部同质化竞争日益加剧，同时逐渐迎来混业、跨界、跨境的全竞争时代，或将倒逼券商业务转型，行业竞争格局目前主要体现在以下几个方面：

### 1. 行业全面转型，线上扩张迅速

随着“一人一户”的放开和互联网金融的快速发展，行业内竞争加剧，倒逼证券公司经纪业务从传统的线下网点扩张到“线上+线下”结合的竞争模式转变，以降低服务成本，提升运营效率。凭借对客户需求的深入理解和多元化的业务平台，证券公司加快互联网获客入口的建设及大数据应用平台的构建。证券公司通过互联网经纪业务打开线上渠道，开展资产管理服务，发挥证券公司的综合服务能力，提高客户满意度。

### 2. 证券行业市场化进程持续

2016 年证券行业市场化持续推进，两家全牌照合资券商陆续通过证监会审批，此外，还有多家券商等正处于审批过程中。银行、保险、信托、互联网公司等其他领域各类机构将通过收购、参股等方式将业务拓展至证券领域，证券行业市场化发展将长期持续。随着行业市场化程度的提高，券商间竞争将日益激烈，券商将从同质化经营向差异化经营转型。

### 3. 国际化扩张全面开展

我国经济在全球的地位不断提升，但我国金融在国际上的地位相对落后。“一带一路”的推进，人民币加入 SDR 等将助力中国金融国际化，更多的中国企业谋求海外融资和并购机会，拓展业务版图，在境外谋求股权和债务融资。随着深港通的开启，沪伦通的推进，国内资本市场将继续接轨国际资本市场。2016 年，多家证券公司相继完成发行 H 股在港上市融资，国内证券公司也将越来越多的通过设立子公司、收购兼并、业务合作等方式将业务触角更多地延伸至海外市场，并进一步提升跨境业务的覆盖领域。

### 4. 证券行业规范化与市场化并重

2016 年，证券市场经历了较大幅度的监管政策调整，监管层对上市公司重大重组，证券公司风险控制指标等方面提出全新监管办法，完善单一业务的风控指标和重组上市认定标准。与此同时，IPO 上市审核速度加快，证券行业改革发展和市场化将是长期趋势。资本市场规范化与市场化并重，旨在规范市场业务操作，维护金融市场稳定，保障投资者的根本利益，有利于证券行业的长远发展。

## (二) 公司发展战略

适用  不适用

公司坚持以客户为中心，优化业务结构，推动改革创新，服务实体经济，建设规范化、市场



化、科技化、国际化证券控股集团，实现在机制、业务、技术、管理等方面创新。

#### 1. 机制创新

公司以增强国有经济活力、提升国有资本功能、实现国有资产保值增值为主要目标，不断优化企业治理结构和管理方式，完善企业经营业绩考核体系和薪酬分配制度，积极稳妥探索中长期激励方式，引导企业建立激励有效、约束到位的收入分配制度。

#### 2. 业务创新

针对目前证券行业业务高度趋同且盈利模式单一等问题，公司提升资产管理、投资咨询和金融衍生工具的创新以及企业并购、重组等投行业务的占比。提升企业创新能力，一方面对原有的服务性业务进行升级改造，另一方面不断开发新的金融服务产品，为公司带来新的利润增长点，增强核心竞争力。

#### 3. 技术创新

公司积极研究人工智能、大数据、云计算等技术在金融领域的运用，布局智能投顾、大数据风控、区块链等热点领域；对标行业信息技术发展先进水平，加强信息系统建设、自主研发能力建设和信息安全保障建设，全面提升信息技术水平，保障新型业务开展、提高工作效能、提升客户体验。

#### 4. 管理创新

公司通过对运营系统、IT 系统、风控合规系统进行全面管理升级，建设服务导向、作业集中、数字支撑、自我优化的集团运营中心，服务于各业务条线的日常运转，有力支撑前台业务的灵活发展，高效促进新业务的快速拓展，全力保障公司持续稳健发展。

### (三) 经营计划

适用  不适用

2017 年，公司将坚持稳中求进工作总基调，牢固树立和贯彻落实新发展理念，以服务实体经济为根本，以满足客户需求为导向，认真把握监管新要求，坚守底线思维、奋力开拓进取，加快培育竞争优势、促进业务健康发展，推动证券控股集团建设迈上新台阶。公司将重点抓好以下几方面的工作：

1. 坚持稳字当头，在促进业务健康发展上下功夫。认真落实证监会《风险控制指标管理办法》和中证协《全面风险管理规范》，不断提高风险管理工作水平，加快现代量化风险管理技术的应用，努力实现风险管理专业化、数量化、信息化，建立风险应急机制，防范流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件，进一步加强风险的监测、控制、化解与处置工作；进一步深化业务合规管理、细化合规监督、完善内控经理管理机制、建立子公司合规管理机制，以执业行为管理、适当性管理、项目质控审核、项目后续管理为重点，不断提升合规管理有效性；以加强合规管理对业务的事中信息搜集能力、反应能力为方向，有效提高合规管理效率；以持续强化监督、加大问责力度为手段，全面落实合规工作责任，不断完善业务合规管理机制；强化业务人员和业务部门负责人是风险合规管理的第一道防线和直接责任人的意识，主动防范风险、控制风险、报告风险、承担责任，持续提高一线业务人员对风险的识别和判断能力。

2. 坚持聚力创新，在培育公司竞争优势上下功夫。创新人才机制，以强化人才队伍建设为重点，创造条件、创设平台，完善人才引进评估体系，吸引优秀人才加盟发展；优化运营管理，整合不同条线的运营职能，逐步建立数字化的大运营中心，支撑“以客户为中心”的业务战略方向，优化流程制度，积极推进 IT 规划和改造、重点加强数据管理，解决制约运营优化的因素；加大科技投入，借助金融科技手段完成业务重构，大幅提升业务电子化程度，积极推进智能投顾业务，以优化用户体验为核心，完善线上业务办理功能和投顾功能、理财功能、社交功能，提升秀财 APP 用户规模与用户黏性；围绕服务“一带一路”、产业结构调整等战略机遇，积极推动国际并购业务，努力做大双创债业务，抢抓绿色债业务和 PPP 项目资产证券化业务。

3. 坚持着眼长远，在完善证券控股集团布局上下功夫。拓展证券控股集团布局，积极介入保险、AMC 等金融持牌行业，加快形成业务协同效应；加快金融科技产业布局，抢抓当前金融科技行业发展的良好机遇，充分承接上海浦东陆家嘴国际金融中心的辐射带动与溢出效应，在培育打造新的区域经济增长点的同时占领行业发展制高点；推进海外业务布局，着眼于服务客户财富管理与资产配置、服务企业“走出去”，探索东吴特色的综合金融服务和国际化道路，为境内外个人和机构提供多元化的产品和专业化的投融资服务。

4. 坚持服务大局，在支持实体经济发展上下功夫。积极利用资本市场，大力推进并购重组、再融资、公司债、资产证券化业务，为地方上市企业做大做强创造条件。积极利用海外业务平台，与中国国新控股合作设立国新东吴海外基金，为优质企业实施“走出去”战略、实现整体或部分上市、开展境内外并购、推动技术升级提供优质服务。推动新三板挂牌业务前移，针对孵化期项

目和初创型企业提供定制化多元化的全方位咨询服务，引导企业与资本市场接触，嫁接有利于企业成长的资源，并以企业需求为导向，重点推动“挂牌后服务”，积极开展多元化业务。服务地方政府投融资需求。以完成国寿东吴苏州城市产业投资基金 100 亿投资为重点，运用金融工具帮助各地政府盘活存量资产、降低融资成本、防范金融风险。抓好重点项目的落实，推动设立国家医药产业创新投资基金，促进高端医药产业集聚发展。

5. 坚持争先进位，在提升行业影响力上下功夫。一是加快经纪业务转型。围绕满足客户需求，进一步优化布局，形成实体网点服务与互联网金融服务的差异化服务体系，促进经纪业务从交易通道向财富管理转型。以 PB 业务为抓手，加大对机构客户开发与服务的力度，稳步提升经纪业务市场地位。建立科学合理的适当性服务体系，健全投资者适当性保护机制。二是提升投行业务占比。提升项目承揽和承做效率，积极申报各类成熟项目。积极开拓产业类公司债券、公募公司债券、专项企业债以及多类型资产证券化产品，广开固收类产品营收渠道。立足长三角根据地，将新三板业务向全国拓展，继续保持行业领先排名。三是稳步发展信用业务。加大两融业务推广力度，进一步开拓高净值机构客户，发挥客户资源优势、专业优势、业务协同优势，为企业和客户提供投融资全产业链服务。四是提升自营业务能力。拓展投资领域，提升投资能力，发展金融衍生品业务，提高场内衍生品投资能力。关注海外资产，适度加大资产配置。完成申请利率互换与黄金期货的交易业务资格，积极介入相关利率、外汇和商品衍生品的套利套保业务，推动 FICC 业务布局。五是稳定资管业务规模。着力提升主动投资能力，提升权益投资能力，加强与机构、与银行合作，寻求资产资金两端的合作机会。加强投后管理，提高项目风险控制技术。

#### (四) 可能面对的风险

适用 不适用

##### 1、公司经营活动面临的主要风险

###### (1) 政策性风险

政策性风险指国家宏观调控措施、与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等的变动，对公司经营产生的不利影响。一方面，国家宏观调控措施对证券市场影响较大，宏观政策、利率、汇率的变动及调整力度与金融市场的走势密切相关，直接影响公司的经营状况；另一方面，证券行业是受高度监管的行业，监管部门出台的监管政策直接关系到证券公司的经营情况变动，若公司在日常经营中因不适应或违反法规、政策或监管要求，可能会受到监管机构罚款、暂停或取消业务资格等行政处罚，导致公司遭受经济损失或声誉损失。

## （2）市场风险

市场风险指因证券价格、利率、汇率等的变动而导致所持有的金融资产产生潜在损失的风险。公司的市场风险主要源于权益类投资及其衍生品、固定收益等非权益类投资及其衍生品投资等，主要集中于公司自营投资和资产管理等业务部门。主要表现为所投资证券价格下降或波动引起的投资损失的可能性等。

## （3）信用风险

信用风险是指公司在开展业务时，发行人、交易对手未能履行合同规定的义务或由于信用等级下降、履约能力下降，给证券公司带来损失的风险。公司的信用风险主要源于非权益类投资业务、融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务、合同履行等方面。主要表现为债券等主体违约、交易对手违约、客户违约等造成公司的损失的可能性。

## （4）操作风险

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

## （5）流动性风险

流动性风险，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。公司的流动性风险可能来自于资产负债结构不匹配、资产变现困难、交易对手延期支付或违约，以及市场风险、信用风险、声誉风险等类别风险向流动性风险的转化等。

## 2、公司已经或计划采取的风险应对措施

报告期内，面对公司各项业务的快速发展和复杂多变的外部环境，公司风险管理工作以围绕“培育风险管理核心竞争力”为中心，以持续推进全面风险管理体系为关键，以落实证监会“新风控指标管理办法”为重点，调整风险管理组织架构、优化管理制度与管理模式、建立量化风控系统、加强事前和事中管理，努力将风险管理工作做精、做细、做实，服务公司业务转型发展。认真落实公司总体风控政策，实施风险总量管理、风险分类管理、业务分类风险管理，建立科学

有效的风险控制指标标准，对公司面临的风险及其变化趋势进行识别、评估、监控、分析和测试，提出相应控制措施及应对方案，始终做到公司风险的可知、可控、可承受。

#### （1）全面风险管理体系推进工作

公司的风险管理组织架构由公司董事会下设的风险控制委员会、经营管理层下设的风险管理委员会及首席风险官、风险管理部门、业务部门和分支机构设立的内控经理四个层级构成。公司设专职首席风险官负责公司全面风险管理工作，风险管理职能部门推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。各业务部门、分支机构在日常工作中全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

公司风险管理制度体系基本健全，自上至下覆盖各类别风险、各项业务，为日常风险管理工作提供明确的依据和指导原则。公司制订了董事会层级的《风险管理基本制度》，并按照风险类型分别制订了公司层级的《风险管理办法》、《市场风险管理实施细则》、《信用风险管理实施细则》、《操作风险管理实施细则》、《流动性风险管理办法》等，同时针对各部门、各业务分别制订了相应的具体风险管理工作规则。

公司制定了年度风险偏好、风险容忍度及风险限额等风险控制指标体系，强化风险控制指标落实执行。风险偏好按照公司收益目标、风险类型（流动性风险、市场风险、操作风险、信用风险）和外部信用评级方面进行描述；风险容忍度指标按照流动性风险、市场风险、操作风险、信用风险分别设置；风险限额管理根据公司资本、业务和风控监管指标情况，针对不同风险种类和各业务条线的特点，由公司经营层根据市场及经营情况在授权范围内对风险容忍度指标进一步分解、细化和落实经营授权限额指标和风险分类关键指标。

公司通过制度建设、分级授权建立和完善了覆盖各项业务的风险应对机制，根据风险评估和预警结果，选择与公司风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略，建立起合理、有效的资产减值、风险对冲、资本补充、规模调整、资产负债管理等应对机制；建立了风险应急机制以应对流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件，制定及时有效的应急应变措施和预案，明确应急触发条件、风险处置的组织体系、措施、方法和程序，并通过压力测试、应急演练等机制进行持续改进；建立了顺畅的风险报告与应对机制，对于一般风险事件由业务部门、风险管理部门及时提出处理方案，风险管理部门应跟踪处理结果；对于重大风险事件，业务部门、风险管理部门将有关情况连同处理建议报首席风险官和相关领导；风险事件处置完成后，业务部

门应会同风险管理部门评估原因，并据此完善制度流程；对于风险责任人，按照公司制度问责或处罚。

公司建立了全面风险综合管理平台，包括风控指标动态监控系统、经纪等分业务综合监控系统、市场风险等分类风险管理系统、压力测试系统、合规管理系统、反洗钱管理系统等。通过采集各业务系统、财务系统、法人清算系统、三方存管系统、外部资讯系统、行情数据和交易所等内外部数据，全面、系统、持续地收集并集中了可能影响公司经营目标的内外部信息，并对公司面临的风险及其来源、特征、形成条件和潜在影响进行识别，按照不同业务、不同部门、不同风险类型进行分类，并汇总计算出公司层面的风险总量，利用系统可以为公司决策者和各层管理人员提供强大灵活的业务数据查询、分析和统计功能，对公司层面的总体风险水平进行审慎评估和有效控制，为公司的日常管理、监督和决策工作提供支持。

公司开展业务或者产品创新建立内部评估和审查机制，对创新业务或产品的合规性、可行性和可能产生的风险进行充分的评估论证，并制定管理制度，明确操作流程、风险控制措施和保护客户利益的措施。风险合规管理部门全程参与创新业务的方案论证、风险总量与收益评估、多元化风险应对策略制定、风控指标设定等，财务部、信息技术部等中后台部门参与部分相关制度的指定和系统建设等，确保中后台的意见在方案、制度、策略中体现。创新活动开展后，注重过程的控制，及时纠正偏离目标行为，建立覆盖公司全部业务的动态监控系统，针对不同业务和产品制定相应的风险限额，对于超越风险限额的情况进行准确计算、动态监控和自动预警，并建立资本补充与业务规模、结构调整机制，明确异常情况的报告路径和处理办法。

公司建立健全信息披露及信息报告机制，规范各类重要信息收集、处理、传递、贮存及使用流程，保障各部门及分支机构、风险管理部门、经营管理层、董事会之间风险信息传递与反馈的及时、准确、完整，信息披露及信息报告的规范、及时。各部门及分支机构对所负责事项的内部控制执行情况、风险暴露状况以及实质性风险损失进行定期和不定期评估与分析，形成内部控制与风险评估报告。

## （2）各类风险的应对措施

### ①市场风险的控制

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

风险评估：公司主要采取计算 VaR 值、beta 系数等灵敏度指标以及压力测试等方式定期或不定期对公司的市场风险承受能力进行测试，针对市场大幅波动带来的风险，加大测算频率，确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。

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

风控指标监测：通过生产系统和风险管理系统对市场风险的动态变化进行逐日监控和报告。重点关注风险限额、投资集中度等关键风控指标的变动情况，以及特定头寸、组合的风险价值、极端不利情况下可能承受的损失等，并就超限额情况及时汇报，并及时作出相应处理措施。

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

## ②信用风险的控制

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

信用评估：在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务等信用交易业务中，重点加强客户适当性管理，通过征信评级全面了解客户资信水平和风险承受能力，综合确定客户信用评级及授信额度；在固定收益证券投资中，尝试建立数量化信用风险评估模型，量化信用风险。

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

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

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

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

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

### ③操作风险的控制

公司主要通过制度流程、授权与制衡、系统建设、内部培训等措施控制操作风险。

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

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

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

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

### ④流动性风险的控制

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



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

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

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

#### **(五) 内部控制实施情况**

√适用 □不适用

##### **1、 公司动态风险控制指标监控和补足机制建立情况**

根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》等相关规定，公司制定了动态风险控制指标监控和补足相关制度，明确了有关风险控制指标的动态监控和补足机制、压力测试机制、建立风险管理及控制指标监控系统。

公司对净资本与流动性相关的风险控制指标进行动态监控，及时掌握指标的变动情况，定期对风控指标监控系统进行数据核对和逻辑校验，不断完善风控指标动态监控系统。公司加强净资本、流动性等风险控制指标的管理，动态监控各项风控指标、优化资产负债结构、实施资本补充、建立资本补足应对措施，有效落实了风险控制指标补足机制。公司对重大业务及可能影响风险控制指标的情况进行了多次压力测试，并不定期实施了综合压力测试。公司每月按规定完成净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表以及流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表、风险控制指标计算表的编制工作，及时向监管机构报送。公司每季度对风险控制指标动态监控系统运营情况进行有效性评估，每半年向公司董事会提交公司风险控制指标的执行情况报告。

证监会于6月16日正式发布修订后的《证券公司风控指标管理办法》及《证券公司风险控制指标计算标准规定》自2016年10月1日起施行。公司结合组织架构和业务发展的具体情况，充分考虑公司战略规划、跨部门业务开展等复杂情形，梳理公司各项资源分布和资金期限配置情况，立

足公司发展现状同时充分预留未来业务空间，对各部门工作进行有效分工，制定了新风控指标管理工作规程。同时为适应公司“前台多元化、后台集中化”的业务管理理念，通过优化投资管理流程、提升信息技术手段等方式落实相关风控指标的前端控制，保证业务效率、防范风险。公司对风险管理系统进行全面升级改造，建立起与业务复杂程度和风险控制指标体系相适应的风险信息技术系统，通过公司各项业务全口径上的数据系统挖掘，自动生成各项风控指标数据的准确率大幅提升，实现了新风控指标动态监测。

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

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

**四、公司因不适用准则规定或国家秘密、商业秘密等特殊原因，未按准则披露的情况和原因说明**  
适用 不适用

## 第五节 重要事项

一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

(一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

适用 不适用

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

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

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

报告期内，公司实施了 2015 年度利润分配方案：以 30 亿股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 3 元（含税），共计派发现金红利 900,000,000 元（含税）。

(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	0	1.5	0	450,000,000	1,498,288,506.38	30.03
2015 年	0	3	0	900,000,000	2,708,494,901.88	33.23
2014 年	0	1.25	0	337,500,000	1,115,452,050.88	30.26

公司 2016 年度利润分配预案：

根据《中华人民共和国公司法》、《公司章程》有关规定，公司拟订了 2016 年度利润分配方案，具体情况如下：

经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司 2016 年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润为 1,498,288,506.38 元，母公司 2016 年度净利润为 1,486,649,685.65 元。

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

1、根据《公司法》第 166 条之规定，按 10%提取法定公积金 148,664,968.56 元；

2、根据《证券法》第 135 条和证监机构字[2007]320 号文之规定，按 10%提取交易风险准备金 148,664,968.56 元；根据《金融企业财务规则》第 44 条和证监机构字[2007]320 号文之规定，按 10%提取一般风险准备金 148,664,968.56 元；提取的一般风险准备和交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算。

三项合计金额为 445,994,905.68 元，因此母公司 2016 年当年实现的未分配利润为 1,040,654,779.97 元，加上年初未分配利润 2,763,189,156.40 元，减去 2016 年年度已分配的现金股利 900,000,000.00 元，年末累计未分配利润为 2,903,843,936.37 元。

综合考虑公司长远发展和投资者利益，2016 年度公司利润分配方案为：

公司 2016 年 12 月 31 日总股本为 30 亿股，公司拟以 30 亿股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 1.5 元（含税），共派送现金红利 4.5 亿元，占当年母公司可供股东现金分配的利润比例为 43.24%，占当年合并报表中归属于母公司所有者的净利润比例为 30.03%。本次分配后，母公司剩余未分配利润 2,453,843,936.37 元，转入下一年度。

**(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**

适用 不适用

**二、承诺事项履行情况**

**(一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项**

适用 不适用

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

**(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目是否达到原盈利预测及其原因作出说明**

已达到  未达到  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

#### (一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明

适用  不适用

#### (二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明

适用  不适用

#### (三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况

适用  不适用

#### (四) 其他说明

适用  不适用

### 六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位：万元 币种：人民币

	现聘任
境内会计师事务所名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	90
境内会计师事务所审计年限	5

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	40
保荐人	西部证券股份有限公司	8,300

#### 聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用  不适用

2016年5月20日，公司2015年年度股东大会审议通过了《关于续聘审计机构的议案》，续聘天衡会计师事务所（特殊普通合伙）为公司2016年度审计机构，对公司财务状况和内部控制进行审计。天衡会计师事务所已连续五年为公司提供年度财务报表审计服务。

#### 审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用  不适用

## 七、面临暂停上市风险的情况

## (一) 导致暂停上市的原因

□适用 √不适用

## (二) 公司拟采取的应对措施

□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

□本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 □本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

## (一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

□适用 √不适用

## (二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

报告期内:									
起诉 (申请) 方	应诉 (被申 请)方	承担连 带责任 方	诉讼仲 裁类型	诉讼 (仲裁) 基本情 况	诉讼 (仲裁) 涉及金 额	诉讼 (仲裁) 是否形 成预计 负债及 金额	诉讼 (仲裁) 进展情 况	诉讼 (仲裁) 审理结 果及影 响	诉讼 (仲裁) 判决执 行情况
公司	广州博 融投资 有限公司	无	民事诉 讼	博融投 资股票 质押式 回购业 务违约, 公司在 苏州中 院提起 诉讼	本 金 2.1 亿 元及相 应利息 、罚息 、费用 等	-	一审判 决公司 胜诉, 二审按 广州博 融投资 有限公司 自动撤 回上诉 处理	-	已执行 完毕, 公司已 收回本 金及相 应利息 、罚息 和费用 等
公司	张跃飞	无	民事诉 讼	张跃飞 股票质 押	本 金 5000 万	-	未开庭	-	-

				押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼	元及相应利息、罚息、费用等				
--	--	--	--	----------------------	---------------	--	--	--	--

### (三) 公司本年度被处罚和公开谴责的情况

适用 不适用

2016年11月23日，公司收到中国证监会江苏监管局行政监管措施决定书《关于对东吴证券股份有限公司采取责令限期改正措施的决定》（[2016]40号）、《关于对丁文韬、马浩博、汤玮亮采取监管谈话措施的决定》（[2016]41号），指出公司向特定对象发布的研究报告《福成深度报告二：3个100亿支撑市值翻倍》存在严重问题，报告审核工作不到位，违反了《发布证券研究报告暂行规定》第九、十条的规定，责令公司进行整改，并要求该报告的领导责任人、直接责任人接受监管谈话。

公司在收到上述决定之后，高度重视，立即按照要求进行整改，整改措施包括对相关责任人进行了严肃问责，进一步加强了研究业务内部管理，完善了研究报告审核发布流程，加强了研究报告业务的合规风控考核，并组织相关员工进行了合规培训。2016年12月，公司就上述整改情况向中国证监会江苏监管局报送了书面整改报告。

### (四) 其他说明

适用 不适用

#### 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

适用 不适用

#### 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

适用 不适用

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

### 十三、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

#### (一) 相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

#### (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

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

适用 不适用

##### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

#### (二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

##### 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

适用 不适用

##### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用



**4、 涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况**

适用 不适用

**(三) 共同对外投资的重大关联交易****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**

适用 不适用

公司第二届董事会第三十八次（临时）会议审议通过了《关于出资设立苏州资产管理有限公司暨关联交易的议案》同意公司以现金方式出资 2.4 亿元，与苏州市国资委及下属国有企业共同参与发起设立苏州资产管理有限公司，公司拟持有苏州资管 20%的股份（详情请见 2016 年 5 月 14 日公司公告）。2016 年 5 月 23 日，苏州资产管理有限公司正式设立。

公司第三届董事会第五次（临时）会议审议通过了《关于全资子公司参与设立、管理国寿东吴（苏州）城市产业投资基金暨关联交易的议案》，同意公司全资子公司东吴创业投资、东吴创新资本以自有资金与国寿财富管理有限公司及其他非关联单位共同设立国寿东吴基金（详见 2016 年 10 月 27 日上海证券交易所公司公告）。截至报告期末，国寿东吴（苏州）城市产业投资企业（有限合伙）已经正式成立。

**3、 临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(四) 关联债权债务往来****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**

适用 不适用

**3、 临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(五) 其他**

适用 不适用

报告期内，公司无其他重大关联交易，其他日常关联交易等事项详见财务报告附注中的有关内容。

## 十五、重大合同及其履行情况

### (一) 托管、承包、租赁事项

#### 1、 托管情况

适用 不适用

#### 2、 承包情况

适用 不适用

#### 3、 租赁情况

适用 不适用

### (二) 担保情况

适用 不适用

### (三) 其他重大合同

适用 不适用

## 十六、其他重大事项及期后事项

适用 不适用

### 1. 营业部新设及迁址情况

#### ①新设营业部

序号	营业部名称
1	义乌义东路证券营业部
2	宁波江南路证券营业部
3	东莞虎门证券营业部
4	无锡和风路证券营业部
5	上海浦东新区杨高南路证券营业部
6	苏州工业园区蠡塘路证券营业部
7	苏州工业园区东沙湖路证券营业部
8	苏州通园路证券营业部
9	苏州工业园区唯华路证券营业部
10	苏州工业园区仁爱路证券营业部
11	常州常武中路证券营业部
12	扬中明珠大道证券营业部

13	南通崇川路证券营业部
14	海宁海州西路证券营业部
15	桐乡世纪大道证券营业部
16	沈阳黄河南大街证券营业部
17	大理振兴街证券营业部
18	北京亦庄证券营业部
19	台州云西路证券营业部
20	昆明白云路证券营业部

## ② 营业部迁址

序号	迁址后	迁址前
1	徐州软件园证券营业部	徐州北京北路证券营业部
2	苏州浒关镇文昌路证券营业部	苏州吴中区教场路证券营业部
3	海口丽晶路证券营业部	海口金贸西路证券营业部
4	太仓东盛广场证券营业部	太仓璜泾镇证券营业部
5	南京江东北路证券营业部	南京迈化路证券营业部
6	大连五一广场证券营业部	大连中山路证券营业部
7	苏州东吴南路证券营业部	苏州宝带西路证券营业部
8	镇江解放路证券营业部	镇江黄山北路证券营业部
9	北京市陶然桥证券营业部	北京市东三环中路证券营业部

## 2. 子公司设立、增资事项

2015年12月28日，公司第二届董事会第三十三次（临时）会议审议通过《关于向东吴创业投资有限公司增资的议案》，同意对东吴创投增资6亿元人民币（注册资本增加至12亿元人民币）。2016年1月5日，东吴创投完成增资事项，注册资本由“60,000万元整”变更为人民币“120,000万元整”，并完成了相关工商变更事宜。

2015年8月25日，公司与苏州工业园区华都物资贸易有限公司（以下简称“华都物贸”）签订了《股权转让协议书》，拟收购华都物贸持有的东吴期货4%股权。2016年1月14日，东吴期货办理完成股权的工商变更手续，变更完成后，公司持有东吴期货93.8%的股权。

2016年6月12日，公司取得了中国证监会《关于核准东吴证券股份有限公司在香港特别行政区设立东吴证券（香港）金融控股有限公司的批复》（证监许可[2016]1266号），核准公司以自有资金出资，在香港特别行政区设立东吴证券（香港）金融控股有限公司，注册资本为港币1亿元。2016年6月27日，东吴香港在香港完成了注册手续。2016年12月13日，公司第三届董事会第六次（临时）会议审议通过了《关于向东吴证券（香港）金融控股有限公司继续增资的议案》，同意向东吴证券（香港）金融控股有限公司继续增资10亿港元（注册资本增加至11亿港元），授权公司经营管理层在符合监管要求的前提下，全权办理涉及增资事项的相关手续；同意

东吴证券（香港）金融控股有限公司的资金使用规划，并在符合监管和公司内部投资管理要求的前提下，决定具体的资金使用安排。

2017年2月27日，公司第三届董事会第七次（临时）会议审议通过了《关于向东吴创新资本管理有限责任公司增资的议案》，同意对东吴创新资本增资20亿元人民币（注册资本增加至40亿元人民币）；授权公司经营管理层在符合监管要求的前提下，在上述额度内确定具体增资到位的时间，并根据东吴创新资本的业务需求，分期投入资金，以及全权办理涉及增资事项的相关手续。

### 3. 发行公司债及证券公司短期公司债

2016年7月16日，公司第三届董事会第二次（临时）会议审议通过了《关于公司发行2016年公司债券的议案》，同意公司发行总规模不超过人民币25亿元（含25亿元）的公司债券，可一期或分期发行，期限为不超过5年（含5年），可以为单一期限品种，也可以为多种期限的混合品种，用于补充公司营运资金。同日，董事会审议通过了《关于公司发行短期公司债券的议案》，发行规模实行余额管理，待偿还短期公司债券余额不超过净资产的60%；公司根据净资产变化情况自主控制发行总额度；根据公司实际需要，可多次滚动发行。2016年7月28日，公司2016年第一次临时股东大会审议通过了上述事项。

2017年2月14日，中国证监会以《关于核准东吴证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2017]215号）文件，核准公司向合格投资者公开发行面值总额不超过25亿元的公司债券。本次债券于2017年3月10日进行簿记建档，债券发行工作于2017年3月14日结束，实际发行规模为人民币25亿元，最终票面利率为4.70%。

## 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

√适用 □不适用

#### 1. 精准扶贫规划

基本方略：公司以习近平总书记系列重要讲话精神为指导，紧紧围绕“五位一体”总体布局和“四个全面”战略布局，积极落实《中共中央国务院关于打赢脱贫攻坚战的决定》、《“十三五”脱贫攻坚规划》以及《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》的要求，响应中国证券业协会“一司一县”结对帮扶行动号召，把打赢脱贫攻坚战作为崇高的政治责任。公司发挥证券行业优势，以消除贫困为目标，以精准扶贫为手段，以制度创新为动力，明

确教育、产业、金融三大帮扶举措，形成多层次、多渠道、多方位的精准扶贫工作格局，不断提升贫困地区自我发展能力。

总体目标：公司利用自身专业优势，与当地政府建立长效帮扶机制，成为当地政府的金融顾问，选派公司优秀人才到当地政府挂职，帮助完善当地金融业布局，支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，适时设立证券营业部，资助贫困乡镇留守儿童完成学业，实现教育脱贫，安排志愿者团队赴贫困地区开展关爱志愿服务活动。

主要任务：

(1) 深入了解和掌握贫困地区企业的实际情况，因地制宜地完善企业发展规划，发挥专业优势，通过资本市场服务实体经济。

(2) 适时设立证券营业部，积极开展经纪业务、投行业务和投资者教育工作。

(3) 增加贫困地区教育基础设施建设投入，支持贫困地区幼儿园、中小学的宿舍、食堂、图书室等教育基础设施建设。

(4) 资助贫困地区中小學生，每年资助不少于 200 名学生，使他们在学业中有基本的生活保障，充实更多的知识与技能，再回报家庭和社会。

(5) 选派志愿者团队赴贫困地区对口帮扶学校开展关爱志愿服务活动。

保障措施：

(1) 与对口帮扶地区签订战略合作协议，保障扶贫工作的落实。

(2) 选派业务精英赴贫困地区挂职，探索恰当的扶贫模式，推进落实既定事项。

(3) 选派业务骨干赴贫困地区走访调研，保持金融团队的稳定与专业性，充分挖掘、提升当地企业的潜力，支持当地企业利用多层次资本市场融资。

(4) 持续维护好“东吴证券慈善爱心基金”平台，汇集集体的力量办大事。

## 2. 年度精准扶贫概要

(1) 2016 年 9 月，在《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》发布的当天，公司率先赴铜仁市，向春晖励志基金捐赠了 50 万元，支持贫困地区教育基础设施建设。

(2) 公司成立精准帮扶领导小组、教育公益帮扶工作小组及产业金融帮扶工作小组，组长均由公司领导担任，充分保障了精准扶贫工作的顺利开展。

(3) 公司积极响应中国证券业协会“一司一县”结对帮扶行动的号召，经过实地调研与走访，将铜仁市、石阡县、松桃苗族自治县列为“一司一县”结对帮扶贫困地区。

(4) 2016 年 10 月，公司与铜仁市人民政府签订《战略合作协议》，建立精准扶贫的长效工作机制，确定了从“教育、产业、金融”三个方面开展精准扶贫。

(5) 2016 年 12 月，公司获批在铜仁地区设立证券营业部，为开展经纪业务、投行业务和投资者教育工作打下基础。

(6) 公司选派业务精英俞斐，赴贵州省铜仁市石阡县挂职县金融办副主任，进一步推进扶贫工作落地生根。

(7) 公司多次选派投资银行总部、固定收益总部、场外市场总部的业务骨干走访调研铜仁市的多家平台公司及企业，多次召开资本市场融资座谈会，提出了整合平台公司做大做强的方案和建议。目前公司与九龙地矿签订了战略合作协议，正在开展绿色项目收益债的方案设计和可行性研究。同时与多家企业达成了初步合作意向，积极制定相应的融资解决方案。

(8) 公司三名业务骨干入选“苏州帮扶铜仁教授专家库”，积极参与多种形式的对口帮扶活动，为铜仁地方经济社会发展献计献策，帮助铜仁各地各行业解决发展中面临的实际困难和问题，加快提升铜仁人才规模和水平，促进科技成果转化，推进产业转型升级。

(9) 公司开展“东吴牵手行动”精准帮扶活动，通过“一对一”、“一对多”或“多对一”的方式资助石阡县和松桃苗族自治县的贫困中小學生，使 200 名贫困学生可获得人民币 2000 元/年/人，首批资助款共 40 万元于 2016 年 12 月已拨付到位。

(10) 公司领导率领志愿者团队，赴石阡县和松桃苗族自治县对口帮扶学校，举行捐助仪式及课堂交流活动，为 200 名受助学生送来助学金和学习用品。同时，公司还就地举办了金融讲座，为贫困地区的学员们普及理财规划、投资组合、财富管理、风险防控等基础金融知识。

(11) 公司先后两次举办爱心拍卖活动，筹得善款 5.6 万元，汇入“东吴证券慈善爱心基金”，将用于贫困地区的教育公益帮扶。

### 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	155.6
2. 物资折款	3.37
3. 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	200
二、分项投入	
4. 教育脱贫	
其中：4.1 资助贫困学生投入金额	26.57
4.2 资助贫困学生人数（人）	116
4.3 改善贫困地区教育资源投入金额	50
7. 兜底保障	
其中：7.1 帮助“三留守”人员投入金额	16.2
7.2 帮助“三留守”人员数（人）	81
7.3 帮助贫困残疾人投入金额	0.6
7.4 帮助贫困残疾人数（人）	3
8. 社会扶贫	
8.3 扶贫公益基金	65.6

注：总体情况中“资金”含扶贫公益基金 65.6 万元。

#### 4. 后续精准扶贫计划

（1）积极参与贫困地区供给侧结构性改革。随着供给侧结构性改革和国企改革的深入推进，跨行业、跨地区、跨所有制的产业并购重组将在“三去一降一补”中发挥重要作用。公司将积极拓展业务空间，推进产业整合，创新并购重组方式，丰富并购重组支付手段，支持上市公司并购重组贫困地区企业，支持贫困地区企业通过资产注入、引入战略投资者、吸收合并、整体上市等多种方式做优做强，更好地支持经济结构转型和产业升级。

（2）探索“证券行业产业扶贫引导基金”模式，引导社会资本、促进贫困地区产业发展，服务贫困地区经济发展，通过扶持贫困地区特色产业，助力贫困地区产业发展，帮助贫困地区从根本上实现脱贫致富。

（3）按照设立营业网点的计划及监管部门的要求，公司将逐步落实经纪业务、投行业务及各项综合金融业务在营业网点的开展。在普及证券法规和金融知识、传播理性投资理念的基础上，扩大业务覆盖面，拓展服务的广度和深度，帮助铜仁市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。

（4）充分发挥资本市场在服务国家脱贫攻坚战略中的作用，利用交易所 IPO、新三板挂牌及债权融资对贫困地区企业的绿色通道，积极有效地促进私募市场为贫困地区提供融资服务，通过多层次资本市场融资支持铜仁市、石阡县、松桃苗族自治县的企业。

(5) 为贫困地区提供多方位的资本市场教育培训服务；联合贫困地区政府扶贫机构等相关单位举办各类资本市场发展研讨会，开展业务交流，不断深入探讨证券行业支持贫困地区实体经济发展、解决中小微企业融资难等方面的举措思路。

(6) 加强贫困地区投资者合法权益保护和教育。根据贫困地区金融消费者需求特点，有针对性地设计开展投资者教育活动，提高投资者风险责任意识，配合有关部门严厉打击金融欺诈、非法集资等非法金融活动，维护贫困地区投资者合法权益。畅通投资者投诉的处理渠道，完善多元化纠纷调解机制，优化资本市场生态环境，促进资本市场长期健康稳定运行。

(7) 支持贫困地区特色产品，充分利用消费扶贫平台发挥互联网在助推脱贫攻坚中的作用，帮助贫困地区特色产品树立品牌形象，拓宽销售市场。对于需要大批量采购的商品，公司优先考虑从定点帮扶地区购买，并建立较为长期的购货渠道，支持当地产业发展。

## (二) 社会责任工作情况

适用 不适用

公司将在披露2016年年度报告的同时，披露《东吴证券2016年度社会责任报告》，详见上海证券交易所网站 ([http:// www. sse. com. cn](http://www.sse.com.cn))。

## (三) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其子公司的环保情况说明

适用 不适用

## (四) 其他说明

适用 不适用

## 十八、可转换公司债券情况

### (一) 转债发行情况

适用 不适用

### (二) 报告期转债持有人及担保人情况

适用 不适用

### (三) 报告期转债变动情况

适用 不适用

报告期转债累计转股情况



适用 不适用

(四) 转股价格历次调整情况

适用 不适用

(五) 公司的负债情况、资信变化情况及在未来年度还债的现金安排

适用 不适用

(六) 转债其他情况说明

适用 不适用

十九、报告期内，公司单项业务资格变化

参见本报告“第二节 公司简介和主要财务指标”。

二十、公司无可能影响财务状况和经营成果的表外项目

## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

单位：万股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例（%）	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例（%）
一、有限售条件股份	10,900	4.04	30,000	0	0	0	30,000	40,900	13.63
1、国家持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2、国有法人持股	10,900	4.04	20,900	0	0	0	20,900	31,800	10.60
3、其他内资持股	0	0	9,100	0	0	0	9,100	9,100	3.03
其中：境内非国有法人持股	0	0	9,100	0	0	0	9,100	9,100	3.03
境内自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、外资持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
其中：境外法人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
境外自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
二、无限售条件流通股股份	259,100	95.96	0	0	0	0	0	259,100	86.37
1、人民币普通股	259,100	95.96	0	0	0	0	0	259,100	86.37
2、境内上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
3、境外上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、其他	0	0	0	0	0	0	0	0	0
三、普通股股份总数	270,000	100	30,000	0	0	0	30,000	300,000	100

**2、普通股股份变动情况说明**

√适用 □不适用

2016年1月13日，公司完成了非公开发行股票工作，发行数量为3亿股，并于2016年1月20日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕新增股份登记托管手续。

**3、普通股股份变动对最近一年和最近一期每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）**

√适用 □不适用

报告期内，根据中国证券监督管理委员会2015年12月23日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2015]3035号），公司获准非公开发行人民币普通股股票300,000,000.00股，公司非公开发行后，总股本为3,000,000,000.00股。如按照股本变动前总股本计算，2016年度的每股收益、每股净资产分别为0.55元、6.23元；如按照股本变动后的新股本计算，2016年度的每股收益、每股净资产分别为0.50元、6.74元。

**4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容**

□适用 √不适用

**(二) 限售股份变动情况**

√适用 □不适用

单位：万股

股东名称	年初限售股数	本年解除限售股数	本年增加限售股数	年末限售股数	限售原因	解除限售日期
苏州国际发展集团有限公司	10,900	0	0	10,900	非公开发行限售	2019年8月5日
苏州物资控股（集团）有限责任公司	0	0	7,000	7,000	非公开发行限售	2017年1月20日
张家港市直属公有资产经营有限公司	0	0	3,000	3,000	非公开发行限售	2017年1月20日
中新苏州工业园区城市投资运营有限公司	0	0	3,000	3,000	非公开发行限售	2017年1月20日
宝盈基金-民生银行-宝盈定增38号分级特定多客户资产管理计划	0	0	3,000	3,000	非公开发行限售	2017年1月20日
金鹰基金-交通银行-金鹰穗通定增88号资产管理计划	0	0	3,000	3,000	非公开发行限售	2017年1月20日
江苏省吴中经济技术发展总公司	0	0	3,000	3,000	非公开发行限售	2017年1月20日
苏州历史文化名城发展集团	0	0	3,000	3,000	非公开发	2017年1月20日

有限公司					行限售	
全国社保基金五零三组合	0	0	2,700	2,700	非公开发行限售	2017年1月20日
青岛城投金融控股有限公司	0	0	1,900	1,900	非公开发行限售	2017年1月20日
鹏华基金-光大银行-光大保德信资产管理有限公司	0	0	300	300	非公开发行限售	2017年1月20日
金鹰基金-工商银行-金鹰唐朝资本新常态1号资产管理计划	0	0	100	100	非公开发行限售	2017年1月20日
合计	10,900	0	30,000	40,900	/	/

## 二、证券发行与上市情况

### (一) 截至报告期内证券发行情况

√适用 □不适用

单位：亿股 币种：人民币

股票及其衍生证券的种类	发行日期	发行价格(或利率)	发行数量	上市日期	获准上市交易数量	交易终止日期
普通股股票类						
A股	2016-01-13	11.80	3	2016-01-20	3	-
短期融资券 16 东吴证券 CP001	2016-04-15	2.95%	15	2016-04-18	15	2016-07-15

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

√适用 □不适用

2016年1月13日，公司完成了非公开发行股票工作，发行数量为3亿股，发行价格11.80元/股，募集资金总额为35.4亿元，并于2016年1月20日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕新增股份登记托管手续。发行完成后，公司总股本由27亿增加至30亿。公司于2016年2月5日完成了工商变更手续，公司注册资本有27亿元变更为30亿元。

报告期内，公司共完成1期，15亿元的短期融资券发行工作。

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

√适用 □不适用

报告期内，公司非公开发行股票3亿股，总股本增加至30亿股。截止报告期末，公司总资产为89,476,701,728.74元，负债总额为68,987,482,764.44元。

## (三) 现存的内部职工股情况

□适用 √不适用

## 三、 股东和实际控制人情况

## (一) 股东总数

截止报告期末普通股股东总数(户)	123,482
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	120,885
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0
年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0

## (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

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增 减	期末持股数 量	比例(%)	持有有限售 条件股份数 量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
苏州国际发展集团有限公司	0	693,371,528	23.11	109,000,000	质押	173,500,000	国有法人
中国人寿保险(集团)公司—传统—普通保险产品	0	130,000,000	4.33	0	无	0	境内非国有法人
中新苏州工业园区城市投资运营有限公司	30,000,000	100,000,000	3.33	30,000,000	无	0	国有法人
张家港市直属公有资产经营有限公司	30,000,000	100,000,000	3.33	30,000,000	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	11,770,603	72,678,449	2.42	0	无	0	未知
苏州物资控股(集团)有限责任公司	70,000,000	70,000,000	2.33	70,000,000	无	0	国有法人
苏州高新区国有资产经营公司	0	70,000,000	2.33	0	无	0	国有法人
苏州市营财投资集团公司	0	64,578,554	2.15	0	无	0	国有法人
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	0	61,832,770	2.06	0	无	0	国有法人

苏州信托有限公司	0	53,120,000	1.77	0	无	0	国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
苏州国际发展集团有限公司	584,371,528	人民币普通股	584,371,528				
中国人寿保险(集团)公司—传统—普通保险产品	130,000,000	人民币普通股	130,000,000				
中新苏州工业园区城市投资运营有限公司	70,000,000	人民币普通股	70,000,000				
张家港市直属公有资产经营有限公司	70,000,000	人民币普通股	70,000,000				
中国证券金融股份有限公司	72,678,449	人民币普通股	72,678,449				
苏州高新区国有资产经营公司	70,000,000	人民币普通股	70,000,000				
苏州市营财投资集团公司	64,578,554	人民币普通股	64,578,554				
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	61,832,770	人民币普通股	61,832,770				
苏州信托有限公司	53,120,000	人民币普通股	53,120,000				
昆山创业控股集团有限公司	39,147,800	人民币普通股	39,147,800				
上述股东关联关系或一致行动的说明	<p>苏州国际发展集团有限公司和苏州市营财投资集团公司、苏州信托有限公司之间为存在控制关系的关联方。苏州国际发展集团有限公司持有苏州市营财投资集团公司 100% 的股权，同时持有苏州信托有限公司 70.01% 的股权，因此，苏州国际发展集团有限公司、苏州市营财投资集团公司和苏州信托有限公司为一致行动人。</p> <p>未发现上述其他股东之间存在关联关系，也未发现上述其他股东属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。</p>						

## 前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√适用 □不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	苏州国际发展集团有限公司	109,000,000	2019年8月5日	0	持有之日起60个月不转让
2	苏州物资控股(集团)有限责任公司	70,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
3	张家港市直属公有资产经营有限公司	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让

4	中新苏州工业园区城市投资运营有限公司	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
5	宝盈基金-民生银行-宝盈定增38号分级特定多客户资产管理计划	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
6	金鹰基金-交通银行-金鹰穗通定增88号资产管理计划	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
7	江苏省吴中经济技术发展总公司	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
8	苏州历史文化名城发展集团有限公司	30,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
9	全国社保基金五零三组合	27,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
10	青岛城投金融控股有限公司	19,000,000	2017年1月20日	0	持有之日起12个月不转让
上述股东关联关系或一致行动的说明		未发现上述股东之间存在关联关系，也未发现上述股东属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人			

### (三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

## 四、控股股东及实际控制人情况

### (一) 控股股东情况

#### 1 法人

适用 不适用

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

#### 2 自然人

适用 不适用

#### 3 公司不存在控股股东情况的特别说明

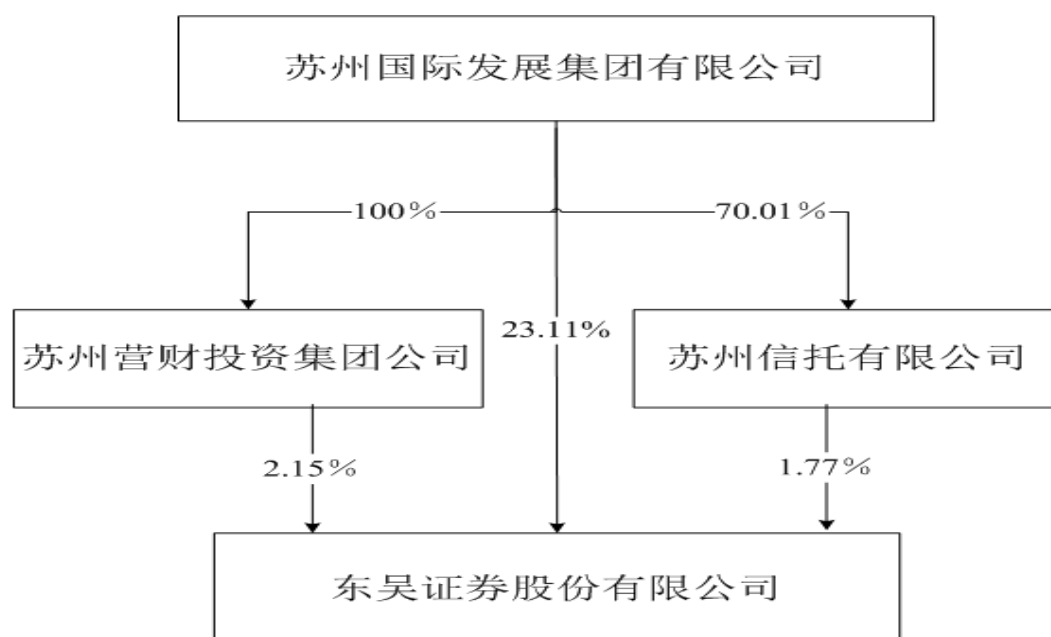
适用 不适用

#### 4 报告期内控股股东变更情况索引及日期

适用 不适用

## 5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

√适用 □不适用



## (二) 实际控制人情况

## 1 法人

√适用 □不适用

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

## 2 自然人

□适用 √不适用

## 3 公司不存在实际控制人情况的特别说明

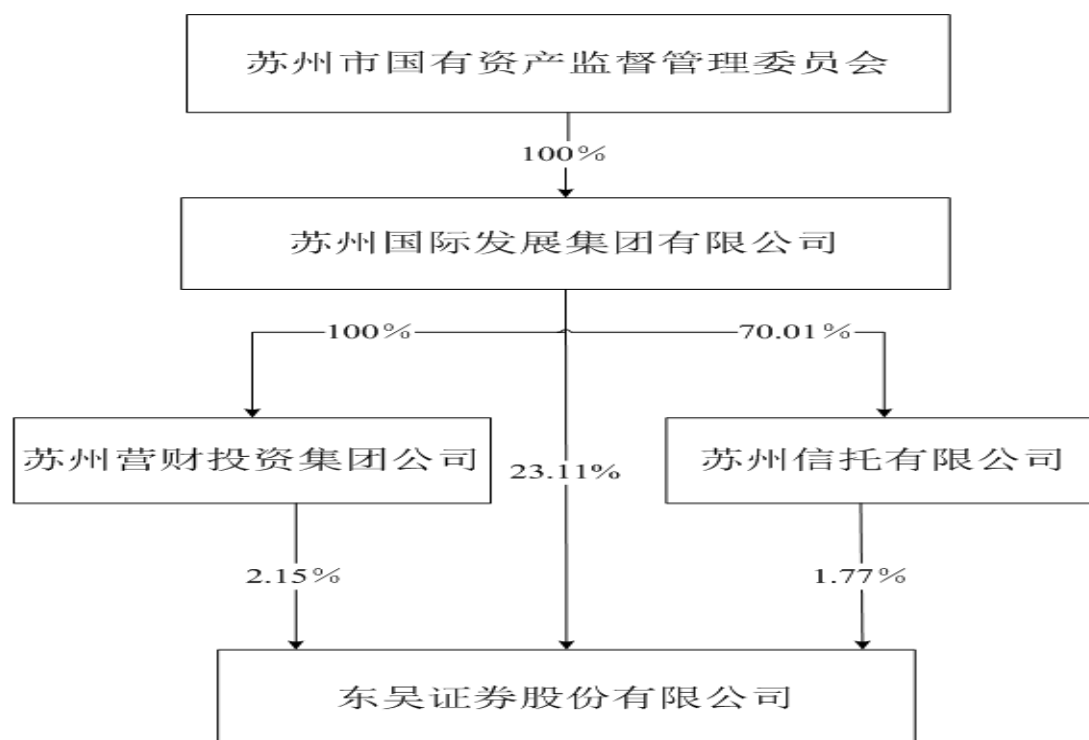
□适用 √不适用

## 4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期

□适用 √不适用

## 5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图

√适用 □不适用



#### 6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用 不适用

#### (三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍

适用 不适用

#### 五、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

#### 六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用



## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

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

√适用□不适用

单位：股

姓名	职务(注)	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	年初持股数	年末持股数	年度内股份增减变动量	增减变动原因	报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元)	是否在公司关联方获取报酬
范力	董事长	男	50	2014-01-18	2019-05-19	0	0	0	-	97.7	否
	总裁			2012-03-13							
朱剑	董事	男	53	2015-09-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
宋子洲	董事	男	56	2014-11-18	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
钱晓红	董事	女	47	2010-05-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
朱建根	董事	男	53	2015-09-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
张统	董事	男	45	2013-05-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
马震亚	职工董事	男	50	2011-03-01	2019-05-19	0	0	0	-	92.9	否
	副总裁			2008-06-16							
	财务负责人			2010-05-08							
金德环	独立董事	男	63	2014-04-16	2019-05-19	0	0	0	-	12	否
裴平	独立董事	男	59	2016-05-20	2019-05-19	0	0	0	-	8	否
韩晓梅	独立董事	女	41	2011-10-08	2017-10-07	0	0	0	-	12	否
黄祖严	独立董事	男	72	2011-10-08	2017-10-07	0	0	0	-	12	否
方敏	监事会主席	女	53	2016-01-15	2019-05-19	0	0	0	-	75.61	否
	职工监事			2016-01-12							
林峰	监事会主席 (离任)	男	58	2014-11-14	2016-01-12	0	0	0	-	0	否
袁维静	监事	女	53	2015-09-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
唐焯	监事	男	52	2010-05-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
邴美英	监事	女	55	2016-05-20	2019-05-19	0	0	0	-	0	是
陆春喜	监事(离任)	男	54	2004-03-25	2016-05-07	0	0	0	-	0	是
马晓	监事	男	50	2013-05-08	2019-05-19	0	0	0	-	0	是

杭五一	职工监事	女	54	2008-08-22	2019-05-19	0	0	0	-	99.54	否
李齐兵	副总裁	男	50	2011-05-18	2019-05-19	0	0	0	-	92.4	否
孙中心	副总裁	男	47	2012-05-17	2019-05-19	0	0	0	-	80.4	否
魏 纯	副总裁	女	37	2012-05-14	2019-05-19	0	0	0	-	80.44	否
	董事会秘书			2008-06-25							
冯 恂	副总裁	女	39	2016-12-13	2019-05-19	0	0	0	-	0	否
张剑宏	合规总监 (离任)	男	51	2013-11-26	2016-02-13	0	0	0	-	76.27	否
	首席风险官			2016-01-15	2019-05-19						
朱卫国	合规总监	男	54	2016-02-14	2019-05-19	0	0	0	-	80.90	否
刘 辉	副总裁 (离任)	男	46	2012-12-26	2016-01-15	0	0	0	-	0	否
任少华	副总裁 (离任)	男	51	2016-01-15	2016-12-09	0	0	0	-	92.25	否
合计	/	/	/	/	/	0	0	0	/	912.41	/

- 注：1、林峰先生于2016年1月辞去监事会主席职务，报告期内未以监事身份在公司领取薪酬；刘辉先生于2016年1月辞去副总裁职务，报告期内未以高管身份领取薪酬；冯恂女士于2016年12月起担任公司高管，报告期内未以高管身份在公司领取薪酬。
- 2、公司非独立董事、职工监事、高级管理人员薪酬仍在确认过程中，其余部分待确认后另行披露。
- 3、根据《证券公司治理准则》，公司对相关人员的绩效实行延期支付。
- 4、公司董事、监事及高级管理人员不存在非现金薪酬的情况。

姓名	主要工作经历
范 力	范力先生，中国国籍，1966年12月出生；硕士，高级经济师。现任公司党委书记、董事长、总裁、苏州国际发展集团有限公司副董事长、江苏省第十二届人民代表大会代表。1989年8月至1997年11月在共青团苏州市委员会历任常委、办公室主任兼事业部部长。1997年11月至2002年4月在苏州证券历任投资部副经理、办公室主任、人事部经理、总裁助理；2002年4月至2012年3月在东吴证券历任董事会秘书、经纪分公司总经理、副总裁、董事、常务副总裁；2012年3月至2013年5月在东吴证券任总裁、董事；2013年5月至2014年1月在东吴证券任总裁、副董事长。2014年1月至今任公司党委书记、董事长、总裁。
朱 剑	朱剑先生，中国国籍，1963年12月出生，本科。现任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事，公司董事。1982年6月至1996年8月历任苏州市财政局办事员、科员、副科长、科长；1996年9月至2002年2月任苏州丝绸集团公司总会计师；2002年3月至2008年6月任苏州工业投资有限公司总会计师；2008年7月至今任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事。
宋子洲	宋子洲先生，中国国籍，1960年1月出生；大学学历，学士学位。现任中国人寿资产管理有限公司副总裁，国寿财富管理有限公司董事，公司董事。1984年8月参加工作，曾在对外经济贸易合作部办公厅、中国对外贸易运输(集团)总公司工作，1999年11月起历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理，2004年8月至2007年8月任中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监，2007年8月至2013年3月任中国人寿资产管理有限公司首席风险管理执行官，2013年3月至今任中国人寿资产管理有限公司副总裁。
钱晓红	钱晓红女士，中国国籍，1969年3月出生；硕士，高级会计师、正高级经济师。现任园区国控董事长、总裁，园区发展董事长，元禾控股董事长，中新苏州工

	业园区市政公用发展集团有限公司副董事长，苏州广融实业有限公司董事，苏州三星电子液晶显示科技有限公司副董事长，苏州银行董事，苏州财融产业投资有限公司董事长，江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司董事长，苏州工业园区股份有限公司董事，公司董事。1991年7月至1999年9月在苏州大学财经学院任会计系教师。1999年10月至2001年3月在苏州工业园区国有资产经营公司任财务科员。2001年4月至2002年10月在苏州工业园区经济发展有限公司任财务部总经理助理。2002年10月至2004年7月在苏州工业园区金鸡湖大酒店有限公司任财务经理。2004年8月至2005年2月在苏州工业园区教育发展有限公司任财务总监。2005年3月至2006年5月在园区国控任审计部总经理。2006年6月至2014年3月任园区国控副总裁。2014年4月起任园区国控董事长、总裁，2009年9月起兼任园区发展董事长。
朱建根	朱建根先生，中国国籍，1963年6月出生，本科。现任苏州市营财投资集团公司总经理，苏州国发创业投资控股有限公司董事，苏州企业征信服务有限公司董事，苏州市基础设施投资管理有限公司董事，紫金财产保险股份有限公司董事，苏州工业园区股份有限公司监事，公司董事。1983年8月至1993年8月任职于苏州市总工会财务科；1993年9月至1996年10月任苏州市财政局所属江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司总经理助理；1996年11月至今历任苏州市营财投资集团公司投资部职员、投资部经理、公司副总经理、总经理。
张统	张统先生，中国国籍，1971年4月出生；本科，注册会计师。现任苏州国际发展集团有限公司监事、资产管理部经理，江苏东吴保险经纪有限公司董事，公司董事。1993年8月至2000年3月在苏州丝绸印花厂任生产计划科科长、染整车间副主任、成品车间主任；2000年4月至2006年4月在江苏公证会计师事务所任审计、评估师、项目经理、高级经理；2006年4月起历任苏州国际发展集团有限公司资产管理部副经理、经理。
马震亚	马震亚先生，中国国籍，1966年10月出生；硕士，会计师；高级经济师。现任公司董事、副总裁、财务负责人。1988年10月至2000年2月在苏州市审计局任科员、副主任科员。2000年3月至2002年4月在苏州证券历任财务部副总经理（主持工作）、总经理；2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司历任财务部总经理、财务总监、副总裁、财务负责人；2010年5月至今历任公司财务负责人、副总裁、董事。
金德环	金德环先生，中国国籍，1953年4月出生；硕士、教授；现任上海财经大学金融学院教授，兼任兴证期货有限公司、海证期货有限公司、光大保德信基金管理有限公司、吴江东方丝绸市场股份有限公司独立董事，公司独立董事。曾任上海财经大学财政系副主任、证券期货学院副院长、金融学院副院长。
裴平	裴平先生，中国国籍，1957年4月出生；管理学博士、教授。现任南京大学商学院教授、博士生导师，担任江苏汇鸿国际集团股份有限公司独立董事、江苏金融租赁股份有限公司独立董事、本公司独立董事。曾任南京大学金融与保险学系主任、南京大学商学院副院长等。
韩晓梅	韩晓梅女士，中国国籍，1975年6月出生；管理学博士，教授。现任南京理工大学经济管理学院教授、博士生导师，江苏省广电有线信息网络股份有限公司独立董事，公司独立董事。1994年8月至2005年4月在南京审计学院审计系任教。2005年4月至今在南京理工大学经济管理学院任教。
黄祖严	黄祖严先生，中国国籍，1944年10月出生；本科，高级审计师。现任公司独立董事。1969年12月至1981年6月历任浙江省新昌丝厂基建会计、主办会计、财务科长，1981年7月至1983年12月历任江苏沙洲县财政局办事员、副股长，1984年1月至2004年12月历任江苏省张家港市审计局局长、科长、副局长。2005年1月至2012年1月任苏州海陆重工股份有限公司内部审计人员。
方敏	方敏女士，中国国籍，1963年4月出生，大学本科学历、硕士学位。历任昆山市木材建材公司财务科会计；昆山市财政局人事秘书科科长；昆山市信托投资公司副总经理；东吴证券昆山前进中路证券营业部总经理、太仓城厢证券营业部总经理、昆山总部总监、昆山分公司总经理、东吴证券总裁助理兼昆山分公司总经理。现任公司监事会主席。
袁维静	袁维静女士，中国国籍，1963年7月出生；本科，高级会计师。现任国发集团董事、党委委员、总会计师，苏州信托董事长、江苏银行监事、苏州国发创业投资控股有限公司董事，公司监事。1981年10月至1994年3月在苏州市财政局任工交企财处科员。1994年3月至1996年11月在苏州财政局所属江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司任副总经理；1996年11月至1997年3月在苏州市财政局所属苏州市营财发展集团总公司任副总经理。1997年3月至2002年3月在苏州市工业发展有限公司任副总经理。2002年3月至2004年6月在营财投资任副总经理、总经理、党支部书记。2004年7月起在国发集团历任副总会计师、总会计师、董事、党委委员。2014年9月起兼任苏州信托有限公司董事长。
唐焯	唐焯先生，中国国籍，1964年6月出生；本科。现任昆山市创业控股有限公司总裁，昆山市国科创业投资公司董事长，昆山市创业投资有限公司董事长，公司监事。1984年至1992年在昆山市变压器配件厂任技术员、副厂长。1992年至1994年在昆山市乡镇工业局任办公室秘书。1994年至2000年在昆山市信托投资公司任业务部经理。2000年起至今任昆山创业任副总裁、总裁。

酆美英	酆美英女士，中国国籍，1962年5月出生，大专，会计师。现任张家港市直属公有资产经营有限公司总经理。1981年7月至1998年2月在张家港市粮食系统历任粮食工业企业财务科长，1998年3月至2002年3月任张家港市财政局财政稽查大队办事员，2002年4月至2003年12月任张家港市市级机关事业单位会计核算中心常务副主任，2004年1月至8月任张家港市财政会计函授学校常务副校长，2004年9月至2008年4月任张家港市财政局企业国资科科长，2008年5月至2015年2月任张家港市财政国库收付中心常务副主任，2015年3月至今任张家港市直属公有资产经营有限公司总经理。
马晓	马晓先生，中国国籍，1966年12月出生；大专。现任国发集团财务部经理，公司监事。1986年7月至1994年12月任苏州光明丝织厂统计、会计；1994年12月至1999年8月任苏盘投资咨询公司会计；1999年8月至今在苏州国际发展集团有限公司任财务部会计、财务部副经理、财务部经理。
杭五一	杭五一女士，中国国籍，1962年4月出生；本科，高级经济师。现任本公司工会副主席、职工监事。1979年12月至1991年1月在苏州刺绣研究所任所长室秘书。1991年1月至1997年12月在苏州市工艺局组织处任科员、副处长。1998年1月至2002年3月在苏州市商业银行人事教育处任副处长、处长。2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司任党委办公室主任、人力资源部副总经理、工会副主席、职工监事。2010年5月至2015年6月任公司党委办公室主任、工会副主席、职工监事。2015年6月至今任公司工会副主席、职工监事。
李齐兵	李齐兵先生，中国国籍，1966年9月出生；大学，硕士，会计师、审计师、注册会计师（非执业会员）。现任本公司副总裁。1988年8月至2000年10月在南京市审计局历任科员、副主任科员、主任科员。2000年10月至2002年9月在中国证监会南京特派员办事处稽查处任主任科员。2002年9月至2010年5月在江苏证监局机构监管处历任副处长、处长。2010年6月至2011年5月在国发集团任副总经理。2011年5月至2013年6月任公司副总裁。2013年7月至11月任公司副总裁、合规总监；2013年11月至今任公司副总裁。
孙中心	孙中心先生，中国国籍，1969年5月出生；硕士。现任本公司副总裁。1990年8月至1994年11月在上海铁路分局苏州电务段工作；1994年11月至2002年4月历任苏州证券狮山路营业部电脑部经理、总经理助理、网上交易部总经理；2002年4月至2010年5月历任东吴证券有限责任公司网上交易部总经理、经纪分公司（筹）副总经理、狮山路证券营业部总经理、总裁助理兼苏州新区总部总经理、总裁助理兼苏州分公司总经理；2010年5月至2012年5月任总裁助理兼苏州分公司总经理；2012年5月至今任公司副总裁。
魏纯	魏纯女士，中国国籍，1979年1月出生；硕士。现任本公司副总裁、董事会秘书。2001年7月至2002年4月任苏州证券研究员，2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司历任研究员、办公室秘书、办公室副主任、董事会办公室主任、总裁办公室主任、董事会秘书。2010年5月至2012年5月在东吴证券股份有限公司任董事会秘书、董事会办公室主任、总裁办公室主任。2012年5月至今任公司董事会秘书、副总裁。
冯恂	1977年7月出生；经济学博士，2002年8月至2004年4月任职于东吴证券；2004年4月至2012年5月历任国联证券研究发展部副经理，总经理、国联证券研究所所长、经纪业务管理总部总经理、国联证券总裁助理、副总裁（兼董事会秘书）；2012年6月起历任东吴证券总规划师兼研究所所长、总规划师兼资产管理总部总经理。现任东吴证券副总裁、总规划师兼资产管理总部总经理。
张剑宏	张剑宏先生，中国国籍，1965年3月出生；硕士。现任本公司首席风险官。1988年毕业于中国社会科学院研究生院；历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官。2013年12月至今任公司首席风险官。
朱卫国	朱卫国先生，中国国籍，1962年12月出生；硕士。现任本公司合规总监。本科毕业于复旦大学哲学系，EMBA毕业于西安交通大学。曾任上海市政府智力开发研究所研究人员；苏州铁道师范学院教师；东吴证券营业部总经理、研究所所长、总裁助理兼经纪业务事业部总经理、东吴期货董事长等职务。2016年1月至今任公司合规总监。

其它情况说明

适用 不适用

## (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

√适用□不适用

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务
范力	苏州国际发展集团有限公司	副董事长
朱剑	苏州国际发展集团有限公司	党委委员、董事
钱晓红	苏州工业园区经济发展有限公司	董事长
	苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	董事长、总裁
朱建根	苏州市营财投资集团公司	总经理
张统	苏州国际发展集团有限公司	资产管理部经理
袁维静	苏州国际发展集团有限公司	董事、党委委员、总会计师
	苏州信托有限公司	董事长
唐烨	昆山市创业控股有限公司	总裁
邴美英	张家港市直属公有资产经营有限公司	总经理
马晓	苏州国际发展集团有限公司	计划财务部经理
在股东单位任职情况的说明	无	

## (二) 在其他单位任职情况

√适用□不适用

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务
范力	东吴基金管理有限公司	董事长
朱剑	江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司	董事
	江苏东吴保险经纪有限公司	董事
宋子洲	中国人寿资产管理有限公司	副总裁
	国寿财富管理有限公司	董事

钱晓红	苏州元禾控股股份有限公司	董事长
	中新苏州工业园区市政公用发展集团有限公司	董事
	苏州广融实业有限公司	董事
	苏州三星电子液晶显示科技有限公司	副董事长
	苏州财融产业投资有限公司	董事长
	江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司	董事长
	苏州银行股份有限公司	董事
	苏州工业园区股份有限公司	董事
朱建根	苏州国发创业投资控股有限公司	董事
	苏州企业征信服务有限公司	董事
	苏州市基础设施投资管理有限公司	董事
	苏州工业园区股份有限公司	监事
	紫金财产保险股份有限公司	董事
	苏州市再生资源投资发展有限公司	董事
	苏州银杏置业有限公司	董事长
	苏州国发置业发展有限公司	董事长
	苏州工业园区时尚舞台国际名品经营有限公司	董事长
	苏州盘门旅游开发公司	总经理
张统	江苏东吴保险经纪有限公司	董事
	苏州企业征信服务有限公司	董事长
	苏州市民卡有限公司	董事长
马震亚	东吴创业投资有限公司	董事长
	中证信用增进股份有限公司	监事
金德环	上海财经大学金融学院	教授
	江苏吴江中国东方丝绸市场股份有限公司	独立董事
	光大保德信基金管理公司	独立董事
	兴证期货有限公司	独立董事
	海证期货有限公司	独立董事
裴平	南京大学商学院	教授、博士生导师
	江苏汇鸿国际集团股份有限公司	独立董事

	江苏金融租赁股份有限公司	独立董事
韩晓梅	南京理工大学经济管理学院	教授
	江苏省广电有线信息网络股份有限公司	独立董事
袁维静	江苏银行股份有限公司	监事
	苏州国发创业投资控股有限公司	董事
唐 焯	昆山市国科创业投资公司	董事长
	昆山市创业投资有限公司	董事长
邴美英	张家港市金宏投资发展有限公司	董事长
	张家港市信用再担保有限公司	董事长
	张家港市现代农业投资有限公司	董事
	张家港市长江文化投资发展有限公司	董事
	张家港市蔬菜园艺有限公司	董事
	华润张家港百禾医药有限公司	董事
	张家港市通洲沙西水道综合整治有限公司	董事
	张家港保税区长源热电有限公司	董事
	张家港市农业担保有限公司	董事
	张家港市高铁投资发展有限公司	董事长
马 晓	苏州国发中小企业担保投资有限公司	董事长
	江苏东吴保险经纪股份有限公司	监事会主席
	苏州市信用再担保有限公司	董事长
孙中心	苏州资产管理有限公司	董事
冯 恂	东吴创新资本管理有限责任公司	董事长
	东吴基金管理有限公司	董事
	东吴证券中新（新加坡）有限公司	董事
	东吴证券（香港）金融控股有限公司	董事
朱卫国	东吴期货有限公司	董事长
	苏州股权交易中心有限公司	董事
	苏州金融资产交易中心有限公司	董事
在其他单位任职情况的说明	无	

### 三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序	公司董事、监事的报酬由董事会、监事会审议通过后，报股东大会审议决定。公司高级管理人员报酬由薪酬、考核和提名委员会审议后，再提交公司董事会审议决定。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司外部董事、监事不在公司领取报酬，公司独立董事报酬在参考同行业上市公司的平均水平后确定；公司内部董事、监事和高级管理人员的报酬由公司薪酬考核体系决定。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	公司外部董事、监事不在公司领取除津贴以外的其他薪酬。公司高级管理人员薪酬由基本工资和年度奖金构成，基本工资按月发放，年度奖金根据公司经营目标完成情况提取，结合高级管理人员绩效考核情况进行分配发放。2016 年度高级管理人员基本工资均已按月全额发放，年度奖金按照相关规定分配并预留，预留部分奖金分三年递延发放。
报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计	报告期内，全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计 912.41 万元。

### 四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

√适用 □不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
林 峰	监事会主席	离任	2016 年 1 月 12 日，林峰先生因工作原因辞去监事会主席及职工监事职务。
方 敏	监事会主席	聘任	2016 年 1 月 12 日，公司工会三届四次会员（职工）代表大会选举方敏女士为职工监事；2016 年 1 月 15 日，第二届监事会第十三次（临时）会议选举方敏女士为监事会主席。
裴 平	独立董事	选举	2016 年 5 月 20 日，公司 2015 年年度股东大会选举裴平先生为公司董事。
陆春喜	监事	离任	换届离任
邴美英	监事	选举	2016 年 5 月 20 日，公司 2015 年年度股东大会选举邴美英女士为公司监事
刘 辉	副总裁	离任	2016 年 1 月，因工作原因，刘辉先生向董事会辞去副总裁职务，张剑宏先生向董事会辞去合规总监职务。
张剑宏	合规总监	离任	
任少华	副总裁	聘任	2016 年 1 月 15 日，公司第二届董事会第三十四次（临时）会议聘任任少华先生为公司副总裁、张剑宏先生为公司首席风险官。
张剑宏	首席风险官	聘任	
朱卫国	合规总监	聘任	2016 年 1 月 15 日，公司第二届董事会第三十四次（临时）会议聘任朱卫国先生为公司合规总监，并于 2016 年 2 月 14 日取得证监会无异议函后正式任职。



任少华	副总裁	离任	2016 年 12 月 9 日，任少华先生个人原因，辞去公司副总裁职务。
冯 恂	副总裁	聘任	2016 年 12 月 14 日，第三届董事会第六次（临时）会议聘请冯恂女士为公司副总裁。

报告期内，公司完成了董事会、监事会换届选举工作。2016 年 5 月 20 日，公司 2015 年年度股东大会选举范力、朱剑、宋子洲、钱晓红、朱建根、张统为第三届董事会董事（非职工董事），金德环、裴平、韩晓梅、黄祖严为第三届董事会独立董事；选举袁维静、唐烨、郦美英、马晓为第三届监事会监事（非职工监事），上述董、监事与公司工会三届五次会员（职工）代表大会选举产生的职工代表董事马震亚，职工代表监事方敏、杭五一共同组成公司第三届董事会、监事会。

同日，公司第三届董事会第一次会议选举范力为公司第三届董事会董事长；聘任范力为公司总裁、马震亚、任少华、李齐兵、孙中心、魏纯为公司副总裁，张剑宏为公司首席风险官，朱卫国为公司合规总监；聘任马震亚兼任公司财务负责人、魏纯任公司董事会秘书。公司第三届监事会第一次会议选举方敏为公司第三届监事会监事会主席。

#### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用 不适用

## 六、母公司和主要子公司的员工情况

### (一) 员工情况

母公司在职员工的数量	2,249
主要子公司在职员工的数量	414
在职员工的数量合计	2,663
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	0
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
经纪业务人员	1,416
投行人员	485
投资人员	56
资产管理业务人员	141
财务人员	68
研究人员	99
风险合规及稽核人员	48
信息技术人员	115
其他管理及行政人员	235
合计	2,663
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
博士	30
硕士	758
本科	1,501
大专及以下	374
合计	2,663

### (二) 薪酬政策

适用  不适用

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

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

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

### (三) 培训计划

适用  不适用

2016 年公司举行各类培训共计 95 场次，参加培训人员 1760 余人次，共计 18560 课时，人均培训达 30 课时。2016 年度培训结合公司全面转型创新发展战略，根据新的形势和热点和新业务发展规划和现状，充分利用内部师资，协同业务条线，推动开展内部专题性培训，满足员工开展新业务所需的知识与技能。主要开展了新员工培训、后备干部培训、员工业务技能培训、应知应会学习考试以及协会组织的各类培训。

2017 年公司培训以新员工培训、业务类培训和管理类培训为培训主导，以外部课程、内部课程和微课程为资源支撑，以秀财学苑微信平台、嘉扬培训管理平台、公司在线培训平台为技术支持，以内部讲师队伍培养为桥梁的“3+1”培训方案，助力员工成长，推动公司业务发展。

#### (四) 劳务外包情况

√适用 □不适用

劳务外包的工时总数	135,198 小时
劳务外包支付的报酬总额	6,091,768 元

#### 七、经纪人情况

√适用 □不适用

截至 2016 年 12 月 31 日，公司下属共 54 家营业部取得了证券经纪人制度的实施资格，证券经纪人总数达到 1008 人。

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

2016 年公司证券经纪人制度运行平稳，整体状况良好。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

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

#### (一) 股东和股东大会

股东大会是公司的最高权力机构，公司依据《公司章程》、《公司治理准则》及相关法律法规制订了《股东大会议事规则》，确保了股东大会的召集、提案与通知、召开等程序合法合规，确保公司股东大会的规范运作。公司股东能够按照法律、法规及《公司章程》的规定行使权利，未超越股东大会干预公司的经营管理活动，在人员、资产、财务、机构和业务方面与公司明确分离。报告期内，公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保包括中小股东在内的全体股东能够充分行使自己的权利，享受公司章程规定的合法权益。

## （二）董事与董事会

董事会是公司的常设决策机构，向股东大会负责并报告工作。公司严格依据《公司章程》及相关法律法规的规定制订了《董事会议事规则》，对董事会会议的提案、召集、召开、董事出席、审议程序、表决、决议的执行等均进行了明确、详细的规定，确保董事会的规范运作。

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

公司董事会现由 11 名董事组成，人数和构成符合法律法规的要求，其中股东单位董事 6 名、职工董事 1 名、独立董事 4 名，不少于董事人数的三分之一，所有董事均具有担任证券公司和上市公司董事的任职资格。公司董事尽职尽责，认真履行董事的职责，对董事会的各项议案充分审议和表决，维护了公司和全体股东的权益。

## （三）监事与监事会

监事会是公司的监督机构，对股东大会负责。监事会根据《公司法》和《公司章程》的规定，负责监督公司的财务活动与内部控制，监督董事会、经营管理层及其成员履职行为的合法、合规性。

公司监事会会议的召集、召开、议事方式和表决程序严格按照《监事会议事规则》执行，确保监事会运作规范。公司监事会现由 6 名监事组成，其中职工监事 2 名，通过职工代表大会选举产生，股东代表监事 4 名。公司各监事均具有担任证券公司和上市公司监事的任职资格，在职期间，勤勉尽责，维护了公司和全体股东的权益。

## （四）经营管理层

公司经营管理层负责公司日常经营工作。公司经营管理层人员由董事会聘任，对董事会负责。公司制定了《总经理工作细则》，明确规定了公司管理层的职责和权力。截止报告期末，公司有高级管理人员 8 名，包括总裁 1 名，副总裁 5 名，其中一名副总裁兼任财务负责人、一名副总裁兼任董事会秘书，首席风险官 1 名，合规总监 1 名。公司各高级管理人员均具有担任上

市公司和证券公司高级管理人员的任职资格。公司经营管理层严格执行董事会制定的经营方针，诚信、谨慎、勤勉地行使职权，努力实现公司效益和社会效益的最大化。

经营管理层设三级决策架构，即领导决策层、业务决策层、执行决策层。领导决策层由领导办公会、资产负债管理委员会、风险管理委员会构成。业务决策层设六个委员会，执行决策层下设若干个委员会。

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

## 二、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2015 年年度股东大会	2016-5-20	上海证券交易所网站	2016-5-21
2016 年第一次临时股东大会	2016-7-28	上海证券交易所网站	2016-7-29

股东大会情况说明

适用 不适用

## 三、董事履行职责情况

### (一) 董事参加董事会和股东大会的情况

董事姓名	是否独立董事	参加董事会情况						参加股东大会情况
		本年应参加董事会次数	亲自出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参加会议	出席股东大会的次数
范力	否	11	11	0	0	0	否	2
朱剑	否	11	11	0	0	0	否	2
宋子洲	否	11	11	7	0	0	否	1
钱晓红	否	11	10	0	1	0	否	2
朱建根	否	11	8	0	3	0	是	1
张统	否	11	10	0	1	0	否	2
马震亚	否	11	11	1	0	0	否	2
金德环	是	11	11	2	0	0	否	1
裴平	是	6	6	0	0	0	否	1
韩晓梅	是	11	9	1	2	0	否	2
黄祖严	是	11	11	1	0	0	否	2

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

朱建根董事因公务原因，委托范力董事长出席第三届董事第二次（临时）会议、第三届董事会第三次（临时）会议并代为表决。

年内召开董事会会议次数	11
其中：现场会议次数	3

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

## (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

□适用 √不适用

## (三) 其他

√适用 □不适用

## 1、 董事会会议情况

2016 年度，公司董事会共召开会议 11 次，审议议案 52 项，全部议案表决通过，具体见下表：

会议时间	会议名称	会议议题
2016-1-15	第二届董事会第三十四次 (临时) 会议	1、听取 2016 年度策略报告（非审议事项）
		2、关于公司内部机构新设及调整的议案
		3、关于聘任公司高级管理人员的议案
2016-3-24	第二届董事会第三十五次 (临时) 会议	1、关于公司 2016 年度经营管理计划的议案
		2、关于修订公司会计制度的议案
		3、关于制定《东吴证券股份有限公司信用业务管理基本制度》的议案
		4、关于制定《东吴证券股份有限公司负责人履职待遇、业务支出管理实施细则》的议案
2016-4-18	第二届董事会第三十六次会 议	1、关于 2015 年度董事会工作报告的议案
		2、关于 2015 年年度报告及其摘要的议案
		3、关于 2015 年度财务决算报告的议案
		4、关于 2015 年度利润分配预案的议案
		5、关于 2015 年度合规报告的议案
		6、关于 2015 年度内部控制评价报告的议案
		7、关于公司 2016 年度风险偏好体系的议案
		8、关于 2015 年度社会责任报告的议案
		9、关于确认 2015 年日常关联交易及预计 2016 年日常关联交易的议案
		10、关于公司 2015 年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案
		11、关于 2016 年度自营投资额度的议案
		12、关于续聘审计机构的议案
		13、2015 年度经营管理工作报告（非表决事项）
		14、2015 年度独立董事述职报告（非表决事项）
		15、审计委员会 2015 年履职情况报告（非表决事项）
		16、2015 年度全面风险管理工作报告（非表决事项）
		17、关于召开年度股东大会的议案
2016-4-28	第二届董事会第三十七次 (临时) 会议	1、关于公司 2016 年度第一季度报告的议案
		2、关于提名公司第三届董事会成员（非职工代表董事）的议案
		3、关于确定公司员工基本薪酬总额的议案
2016-5-12	第二届董事会第三十八次 (临时) 会议	1、关于出资设立苏州资产管理有限公司暨关联交易的议案
2016-5-20	第三届董事会第一次会议	1、关于选举公司第三届董事会董事长的议案
		2、关于公司第三届董事会专门委员会组成方案的议案
		3、关于聘任公司总裁的议案
		4、关于聘任公司高级管理人员的议案

		5、关于聘任公司证券事务代表的议案
2016-7-12	第三届董事会第二次（临时）会议	1、关于变更部分非公开发行募集资金用途的议案 2、关于公司发行公司债券的议案 3、关于公司发行短期公司债券的议案 4、关于公司高级管理人员 2015 年度薪酬总额的议案 5、关于召开 2016 年度第一次临时股东大会的议案
2016-7-28	第三届董事会第三次（临时）会议	1、关于东吴证券（香港）金融控股有限公司收购天顺证券集团有限公司的议案 2、关于向东吴证券（香港）金融控股有限公司增资的议案 3、关于修订《东吴证券股份有限公司经纪业务管理制度》的议案
2016-8-17	第三届董事会第四次会议	1、关于 2016 年上半年度合规报告的议案 2、关于 2016 年半年度报告及其摘要的议案 3、关于公司 2016 年上半年募集资金存放与使用情况专项报告的议案 4、2016 年上半年度全面风险管理报告（非表决事项） 5、关于修订《公司风险管理基本制度》的议案 6、关于修订《东吴证券股份有限公司 2015-2017 年资本规划》的议案 7、关于修订《公司治理准则》的议案 8、关于修订《公司信息披露事务管理制度》的议案 9、关于公司开展利率互换业务的议案 10、关于调整信用交易业务总规模的议案
2016-10-26	第三届董事会第五次（临时）会议	1、关于 2016 年第三季度报告的议案 2、关于全资子公司参与设立、管理国寿东吴（苏州）城市产业投资基金暨关联交易的议案 3、关于开展证券投资基金托管业务的议案 4、关于修订《东吴证券股份有限公司投资银行业务基本制度》的议案
2016-12-13	第三届董事会第六次（临时）会议	1、关于收购东吴人寿股份有限公司部分股权的议案 2、关于向东吴证券（香港）金融控股有限公司继续增资的议案 3、关于聘任公司副总裁的议案

## 2、监事会会议情况

2016 年度，公司监事会共召开会议 7 次，审议议案 12 项，全部议案表决通过，具体见下表：

会议时间	会议名称	会议议题
2016-1-15	第二届监事会第十三次（临时）会议	1、关于选举方敏女士为公司第二届监事会主席的议案
2016-4-17	第二届监事会第十四次会议	1、关于 2015 年度监事会工作报告的议案 2、关于 2015 年年度报告及其摘要的议案 3、关于 2015 年度利润分配预案的议案 4、关于公司 2015 年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案 5、关于 2015 年度内部控制评价报告的议案 6、2015 年度稽核审计工作报告（非审议事项）
2016-4-28	第二届监事会第十五次（临时）会议	1、关于公司 2016 年度第一季度报告的议案 2、关于提名公司第三届监事会成员（非职工代表监事）的议案
2016-5-20	第三届监事会第一次会议	1、关于选举公司第三届监事会主席的议案

2016-7-12	第三届监事会第二次（临时）会议	1、关于变更部分非公开发行募集资金用途的议案
2016-8-18	第三届监事会第三次会议	1、关于 2016 年半年度报告及其摘要的议案 2、关于公司 2016 年上半年募集资金存放与使用情况专项报告的议案
2016-10-26	第三届监事会第四次（临时）会议	1、关于公司 2016 年度第三季度报告的议案

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

√适用 □不适用

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

报告期内，公司董事会战略委员会共召开会议 1 次，薪酬、考核与提名委员会召开会议 5 次，审计委员会召开会议 7 次，风险控制委员会召开会议 3 次。公司董事会专业委员会根据公司章程、公司董事会议事规则及各委员会工作细则的规定，分别对公司战略、高管提名、薪酬考核、财务审计、内控审计、风险控制等提出了建议，为公司规范运作发挥了重要作用。

#### 五、监事会发现公司存在风险的说明

√适用 □不适用

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

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

√适用 □不适用

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

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

□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

√适用 □不适用

公司依据《东吴证券股份有限公司董事监事薪酬管理制度》及《东吴证券股份有限公司高级管理人员管薪酬和绩效管理办法》，通过公正透明的董事、监事、及高级管理人员的绩效考核制



度，并以年度公司及各项业务实现的经营业绩对公司高级管理人员进行绩效评价，依据考核结果实施薪酬分配。薪酬分配中将高级管理人员个人收入与公司整体经营业绩、个人分管业务业绩紧密挂钩，激励与约束相结合，发挥正向激励作用。

## 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

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

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

天衡会计师事务所出具了《内部控制审计报告》报告，认为公司于 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。《公司内部控制审计报告》详见上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)

是否披露内部控制审计报告：是

## 十、内部控制责任声明及内部控制制度建设情况

适用 不适用

### （一）内部控制责任声明

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

公司董事会已按照《企业内部控制基本规范》要求对财务报告相关内部控制进行了评价，并认为其在 2016 年 12 月 31 日有效。公司在内部控制自我评价过程中未发现与非财务报告相关的内部控制存在重大缺陷。

### （二）建立财务报告内部控制的依据

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

### （三）内部控制制度建设情况

报告期内，公司依据监管要求、经营环境变化及创新业务发展需要，对经纪、信用、网络金融、投资、投资银行、股转系统、资产管理、研究业务等业务的内部控制制度进行了新增或修订。

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

### （一）公司合规管理体系建设及运行情况

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

报告期内，公司围绕“守住合规底线”的工作要求，做深、做细合规管理工作，以深化业务制度流程梳理、强化员工执业行为管理、细化合规激励与考核为重点，致力于全面提升合规管理有效性，有效防范了公司合规风险，公司合规态势整体平稳、良好。

### （二）合规、稽核检查情况

报告期内，公司合规法务部对投资银行、私募资产管理、互联网金融、资产证券化、机构经纪等业务的合规检查，对 14 家营业部开展了现场检查，共计检查 32 批次。

报告期内，公司稽核审计部开展了对原财富管理中心资产管理业务、信用业务、网络金融业务和场外市场业务等内控合规检查，稽核审计部还进行了营业部负责人离任审计、强制休假审计及其他专项审计、评估等。稽核审计部 2016 年共完成业务部门年度审计、分支机构负责人离任审计、强制休假审计及专项审计等 54 项。此外，稽核审计部按照监管部门的要求开展了合规管理有效性评估工作。

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率	还本付息方式	交易场所
东吴证券股份有限公司 2013 年公司债券	13 东吴债	122288	2013-11-18	2018-11-18	30	6.18%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
东吴证券股份有限公司 2015 年公司债券	15 东吴债	136022	2015-11-9	2020-11-9	25	4.15%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所

公司债券付息兑付情况

适用 不适用

上述债券存续期内均按时兑付利息

公司债券其他情况的说明

适用 不适用

## 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

“13 东吴债” 债券受托管理人	名称	瑞信方正证券有限责任公司
	办公地址	中国北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 15 层
	联系人	杨帆、陈万里
	联系电话	010-66538666
“15 东吴债” 债券受托管理人	名称	东海证券股份有限公司
	办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层
	联系人	宋维平
“13 东吴债” 资信评级机构	名称	鹏元资信评估有限公司
	办公地址	深圳市深南大道 7008 号阳光高尔夫大厦三楼
	名称	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
“15 东吴债” 资信评级机构	办公地址	上海市汉口路 398 号华盛大厦 14F

其他说明：

适用 不适用

## 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

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

## 四、公司债券评级情况

适用 不适用

公司聘请鹏元资信评估有限公司对“13 东吴债”进行评级，并邀请上海新世纪资信评估投资服务有限公司对“15 东吴债”进行评级。根据两家资信评级机构 2016 年为上述债券分别出具的跟踪评级报告，上海新世纪资信评估投资服务有限公司将公司主体信用等级/评级展望由 AA+/稳定调整为 AAA/稳定，将“15 东吴债”的债项等级由 AA+调整为 AAA；鹏元资信评估有限公司亦将公司主体信用等级/评级展望由 AA+/稳定调整为 AAA/稳定，将“13 东吴债”的债项等级由 AA+调整为 AAA。对于上述跟踪评级报告，两家资信评级机构均在各自的官方网站上进行披露。根据交易所对于跟踪评级报告披露时间的要求，预计上述债券的 2017 年跟踪评级报告将于 2017 年 6 月 30 日前披露，提请投资者关注。

**五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况**

√适用 □不适用

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

**六、公司债券持有人会议召开情况**

□适用 √不适用

**七、公司债券受托管理人履职情况**

√适用 □不适用

瑞信方正证券、东海证券作为东吴证券 2013 年公司债券、2015 年公司债券的受托管理人，以维护全体债券持有人的最大利益为行事原则，严格按照《债券受托管理协议》的约定，持续关注公司的资信状况、经营情况、财务状况及募集资金管理运用等情况，根据受托管理协议的有关约定及监管要求履行受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。

债券受托管理人已于 2016 年 6 月 18 日通过上交所网站公告了 2015 年度受托管理事务报告。

**八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标**

√适用 □不适用

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	3,928,423,094.14	5,789,841,791.80	-32.15	主要是本期公司业绩下滑所致
流动比率	1.56	1.66	-6.02	-
速动比率	1.56	1.66	-6.02	-
资产负债率	70.69%	70.38%	0.44	-
EBITDA 全部债务比	12.14%	19.04%	-36.24	主要是本期公司业绩下滑所致
利息保障倍数	2.11	2.82	-25.18	-
现金利息保障倍数	-2.92	0.34	不适用	主要是本期经营活动产生的现金流量净额减少所致
EBITDA 利息保障倍数	2.17	2.87	-24.39	-
贷款偿还率	100%	100%	0	-
利息偿付率	100%	100%	0	-

**九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况**

√适用 □不适用

2016 年，公司其他债务融资工具有：次级债、短期融资券、融资业务债权收益权转让、收益凭证、证金公司转融资、同业拆借。各项融资均按时兑付本金及利息。

#### 十、公司报告期内的银行授信情况

√适用 □不适用

2016 年，公司银行授信总额增加 297 亿元，年末授信总额达 1101 亿元，授信银行 34 家。

#### 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

√适用 □不适用

公司报告期内严格执行公司债券募集说明书相关约定或承诺。

#### 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

√适用 □不适用

2016 年度，公司累计新增发行债券 15 亿元，均为短期融资券；其他累计新增借款 94.33 亿元，包括公司及子公司的短期借款、收益凭证、资产收益权转让融入资金及同业拆借等方式，公司新增借款累计超过上年末净资产的 20%。

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

## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

√适用□不适用

## 审 计 报 告

天衡审字（2017）00647 号

东吴证券股份有限公司全体股东：

我们审计了后附的东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”）财务报表，包括 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东吴证券管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错报导致的重大错报。

### 二、注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为，东吴证券财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴证券 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。

天衡会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师：谈建忠

中国·南京

中国注册会计师：陆德忠

2017 年 4 月 6 日

## 二、财务报表

## 合并资产负债表

2016 年 12 月 31 日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金	5.01	19,840,284,936.00	23,454,179,048.36
其中：客户存款		15,628,391,768.87	19,694,206,086.62
结算备付金	5.02	4,248,147,348.89	4,827,905,019.84
其中：客户备付金		3,651,028,899.21	4,174,930,818.95
拆出资金			
融出资金	5.03	8,618,916,151.39	10,875,406,336.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	5.04	21,769,705,706.86	14,222,827,510.80
衍生金融资产	5.05	6,996,544.22	3,620.00
买入返售金融资产	5.06	16,980,151,202.32	8,923,142,748.05
应收款项	5.07	218,050,440.76	333,743,476.04
应收利息	5.08	743,269,682.21	357,047,813.24
存出保证金	5.09	939,241,198.87	1,012,776,896.33
可供出售金融资产	5.10	13,764,049,563.39	14,337,888,888.16
持有至到期投资	5.12	9,608,843.81	45,804,161.79
长期股权投资	5.13	496,404,077.84	122,232,522.20
投资性房地产			
固定资产	5.14	773,126,092.09	810,769,001.69
在建工程	5.15		751,888.44
无形资产	5.16	177,959,438.04	163,071,501.98
商誉	5.17	235,685,139.34	235,685,139.34
递延所得税资产	5.18	418,351,931.49	167,302,236.93
其他资产	5.19	236,753,431.22	698,598,724.37
资产总计		89,476,701,728.74	80,589,136,533.56
<b>负债：</b>			
短期借款	5.21	180,964,512.50	93,684,509.36
应付短期融资款	5.22	3,880,000,000.00	4,567,350,000.00
拆入资金	5.23		350,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
衍生金融负债	5.05	368,524.97	5,704,972.15
卖出回购金融资产款	5.24	10,824,945,793.82	8,926,452,635.46
代理买卖证券款	5.25	19,566,547,771.23	24,025,978,380.26
代理承销证券款			
应付职工薪酬	5.26	1,037,471,447.61	1,505,489,727.11
应交税费	5.27	205,903,486.46	401,483,551.42
应付款项	5.28	310,597,096.49	70,405,540.42
应付利息	5.29	571,401,277.68	536,703,397.67
预计负债			
长期借款			
应付债券	5.30	17,477,883,546.91	16,466,882,811.73

递延所得税负债	5.18	22,006,180.74	9,617,062.63
其他负债	5.31	14,909,393,126.03	6,877,015,079.34
负债合计		68,987,482,764.44	63,836,767,667.55
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	5.32	3,000,000,000.00	2,700,000,000.00
资本公积	5.33	11,764,002,886.47	8,564,676,213.93
减：库存股			
其他综合收益	5.34	-65,093,242.78	345,269,489.80
盈余公积	5.35	667,334,848.07	518,669,879.51
一般风险准备	5.36	1,672,039,415.89	1,364,956,056.45
未分配利润	5.37	3,188,885,638.08	3,046,345,459.70
外币报表折算差额			
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		20,227,169,545.73	16,539,917,099.39
少数股东权益	5.38	262,049,418.57	212,451,766.62
所有者权益（或股东权益）合计		20,489,218,964.30	16,752,368,866.01
负债和所有者权益（或股东权益）总计		89,476,701,728.74	80,589,136,533.56

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 母公司资产负债表

2016年12月31日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金		16,850,463,481.69	21,827,877,826.47
其中：客户存款		13,933,587,796.42	18,599,561,502.00
结算备付金		4,154,972,704.87	4,745,490,997.69
其中：客户备付金		3,651,028,899.21	4,178,454,731.32
拆出资金			
融出资金		8,618,916,151.39	10,875,406,336.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		11,493,325,389.58	10,938,449,917.30
衍生金融资产		6,996,544.22	3,620.00
买入返售金融资产		9,995,138,683.86	3,939,971,198.05
应收款项	15.01	116,601,445.75	248,448,188.51
应收利息		434,212,649.49	220,941,972.04
存出保证金		113,708,503.30	442,192,492.84
可供出售金融资产		12,332,011,813.82	13,215,748,503.52
持有至到期投资			
长期股权投资	15.02	3,627,131,893.88	2,863,196,035.71
投资性房地产			
固定资产		730,294,694.66	766,136,947.84



在建工程			751,888.44
无形资产		163,702,174.77	144,502,832.85
商誉		11,749,999.80	11,749,999.80
递延所得税资产		358,245,714.50	159,744,426.74
其他资产	15.03	98,803,826.53	122,825,643.51
资产总计		69,106,275,672.11	70,523,438,827.31
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款		3,200,000,000.00	4,000,000,000.00
拆入资金			350,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
衍生金融负债			4,245,522.15
卖出回购金融资产款		9,447,395,602.82	8,321,817,684.26
代理买卖证券款		17,340,932,504.18	22,621,633,084.67
代理承销证券款			
应付职工薪酬		926,234,638.77	1,413,860,035.04
应交税费		171,067,116.65	377,690,536.76
应付款项		35,012,524.92	33,035,400.59
应付利息		555,440,905.34	536,643,200.34
预计负债		517,450.00	1,004,000.00
长期借款			
应付债券		17,477,883,546.91	16,466,882,811.73
递延所得税负债			
其他负债		157,301,293.10	157,862,283.96
负债合计		49,311,785,582.69	54,284,674,559.50
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		3,000,000,000.00	2,700,000,000.00
资本公积		11,656,642,848.19	8,563,640,848.19
减：库存股			
其他综合收益		-13,832,138.17	410,093,725.87
盈余公积		667,334,848.07	518,669,879.51
一般风险准备		1,580,500,594.96	1,283,170,657.84
未分配利润		2,903,843,936.37	2,763,189,156.40
外币报表折算差额			
所有者权益（或股东权益）合计		19,794,490,089.42	16,238,764,267.81
负债和所有者权益（或股东权益）总计		69,106,275,672.11	70,523,438,827.31

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 合并利润表

2016年1-12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		4,645,225,993.82	6,830,161,925.32
手续费及佣金净收入	5.39	2,801,936,935.76	3,821,609,158.46
其中：经纪业务手续费净收入		1,300,163,518.11	2,646,254,123.37
投资银行业务手续费净收入		896,960,983.55	757,556,414.50

资产管理业务手续费净收入		220,606,299.70	206,675,731.33
利息净收入	5.40	192,269,897.05	286,555,551.49
投资收益（损失以“-”号填列）	5.41	1,730,292,974.94	2,383,976,752.02
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		19,095,206.51	2,643,966.52
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5.42	-495,181,738.10	306,628,570.68
汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,675,446.69	1,162,645.34
其他业务收入	5.43	413,232,477.48	30,229,247.33
二、营业支出		2,707,560,109.70	3,106,021,314.08
税金及附加	5.44	122,778,192.27	414,691,579.49
业务及管理费	5.45	1,831,121,366.35	2,656,099,023.42
资产减值损失	5.46	350,764,099.81	22,797,025.87
其他业务成本	5.43	402,896,451.27	12,433,685.30
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,937,665,884.12	3,724,140,611.24
加：营业外收入	5.47	67,541,665.33	18,900,229.51
减：营业外支出	5.48	5,975,272.47	85,774,425.93
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,999,232,276.98	3,657,266,414.82
减：所得税费用	5.49	481,386,540.90	923,973,390.23
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,517,845,736.08	2,733,293,024.59
其中：归属于母公司所有者（或股东）的净利润		1,498,288,506.38	2,708,494,901.88
少数股东损益		19,557,229.70	24,798,122.71
六、其他综合收益的税后净额	5.50	-409,702,768.09	90,185,067.40
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-410,362,732.58	90,065,001.01
（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		-410,362,732.58	90,065,001.01
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		3,076,349.13	
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-418,261,785.72	89,950,510.04
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额		4,822,704.01	114,490.97
6. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		659,964.49	120,066.39
七、综合收益总额		1,108,142,967.99	2,823,478,091.99
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,087,925,773.80	2,798,559,902.89
归属于少数股东的综合收益总额		20,217,194.19	24,918,189.10
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）	5.51	0.50	1.00
（二）稀释每股收益（元/股）	5.51	0.50	1.00

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

**母公司利润表**  
2016 年 1-12 月

单位:元 币种:人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		3,581,367,433.38	6,282,781,739.63
手续费及佣金净收入	15.04	2,360,710,862.88	3,627,018,864.30
其中: 经纪业务手续费净收入		1,145,925,438.59	2,577,600,916.69
投资银行业务手续费净收入		896,960,983.55	757,556,414.50
资产管理业务手续费净收入		257,407,368.95	254,425,174.20
利息净收入		234,312,734.63	283,890,756.38
投资收益(损失以“-”号填列)	15.05	1,374,472,861.06	2,114,401,606.17
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		-63,443.91	
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	15.06	-397,980,366.71	251,315,092.33
汇兑收益(损失以“-”号填列)		1,714,260.88	1,162,645.34
其他业务收入		8,137,080.64	4,992,775.11
二、营业支出		1,707,439,196.36	2,736,566,684.83
税金及附加		112,306,052.20	385,952,277.72
业务及管理费		1,268,319,044.35	2,327,817,381.24
资产减值损失		326,814,099.81	22,797,025.87
其他业务成本			
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,873,928,237.02	3,546,215,054.80
加: 营业外收入		47,338,185.15	5,429,243.23
减: 营业外支出		5,311,193.00	64,497,011.86
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,915,955,229.17	3,487,147,286.17
减: 所得税费用		429,305,543.52	828,465,213.27
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,486,649,685.65	2,658,682,072.90
六、其他综合收益的税后净额		-423,925,864.04	109,760,404.23
(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		-423,925,864.04	109,760,404.23
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		-423,925,864.04	109,760,404.23
3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4. 现金流量套期损益的有效部分			
5. 外币财务报表折算差额			
6. 其他			
七、综合收益总额		1,062,723,821.61	2,768,442,477.13

法定代表人: 范力

主管会计工作负责人: 马震亚

会计机构负责人: 王菁

## 合并现金流量表

2016 年 1-12 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		5,232,660,619.70	6,905,224,108.02
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额			
融出资金净减少额		2,259,329,821.48	
代理买卖证券收到的现金净额			10,446,506,093.34
收到其他与经营活动有关的现金	5.52(1)	8,945,591,642.83	3,190,545,131.00
经营活动现金流入小计		16,437,582,084.01	20,542,275,332.36
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额		6,585,539,832.00	2,622,360,488.73
融出资金净增加额			2,992,460,462.45
代理买卖证券支付的现金净额		4,459,430,609.03	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,294,190,208.09	1,810,617,661.40
拆入资金净减少额		350,000,000.00	1,568,000,000.00
回购业务资金净减少额		5,975,436,468.40	9,989,836,203.86
支付给职工以及为职工支付的现金		1,349,383,107.84	1,081,561,871.73
支付的各项税费		1,068,005,958.64	1,359,674,500.52
支付其他与经营活动有关的现金	5.52(2)	1,542,193,844.71	923,776,689.66
经营活动现金流出小计		22,624,180,028.71	22,348,287,878.35
经营活动产生的现金流量净额		-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			
取得投资收益收到的现金			
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金	5.52(3)	15,846,917.08	624,092.67
投资活动现金流入小计		15,846,917.08	624,092.67
投资支付的现金			
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		153,412,246.63	153,026,510.85
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		270,031,736.00	109,105,445.43
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		423,443,982.63	262,131,956.28
投资活动产生的现金流量净额		-407,597,065.55	-261,507,863.61
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		3,459,352,000.00	36,375,360.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		66,350,000.00	36,375,360.00
取得借款收到的现金		160,000,000.00	80,000,000.00
发行债券收到的现金		8,179,962,216.02	22,667,350,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	5.52(4)	191,445,390.45	13,684,509.36

筹资活动现金流入小计		11,990,759,606.47	22,797,409,869.36
偿还债务支付的现金		7,947,312,216.02	7,913,738,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,469,842,489.54	666,634,920.19
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		3,457,902.31	3,366,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金	5.52(5)	190,729,072.16	22,892,664.37
筹资活动现金流出小计		9,607,883,777.72	8,603,265,584.56
筹资活动产生的现金流量净额		2,382,875,828.75	14,194,144,284.80
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		8,019,116.90	1,315,299.97
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-4,203,300,064.60	12,127,939,175.17
加：期初现金及现金等价物余额		28,181,391,000.34	16,053,451,825.17
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	5.53	23,978,090,935.74	28,181,391,000.34

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 母公司现金流量表

2016年1-12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额		244,659,046.78	
收取利息、手续费及佣金的现金		4,347,121,085.18	6,348,719,245.46
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额			
融出资金净减少额		2,259,329,821.48	
代理买卖证券收到的现金净额			10,770,301,117.39
收到其他与经营活动有关的现金		348,157,324.75	30,183,401.61
经营活动现金流入小计		7,199,267,278.19	17,149,203,764.46
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额			2,131,024,563.56
融出资金净增加额			2,992,460,462.45
代理买卖证券支付的现金净额		5,280,700,580.49	
支付利息、手续费及佣金的现金		788,948,677.66	1,773,305,083.55
拆入资金净减少额		350,000,000.00	1,568,000,000.00
回购业务资金净减少额		4,746,342,911.99	6,900,339,481.11
支付给职工以及为职工支付的现金		1,159,290,068.88	929,451,054.42
支付的各项税费		955,563,417.71	1,243,541,922.65
支付其他与经营活动有关的现金		484,238,580.20	502,660,141.11
经营活动现金流出小计		13,765,084,236.93	18,040,782,708.85
经营活动产生的现金流量净额		-6,565,816,958.74	-891,578,944.39
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			

取得投资收益收到的现金		182,645,543.52	184,634,000.00
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		15,570,325.48	398,750.23
投资活动现金流入小计		198,215,869.00	185,032,750.23
投资支付的现金			
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		145,181,072.82	139,848,832.06
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		763,999,302.08	505,618,750.00
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		909,180,374.90	645,467,582.06
投资活动产生的现金流量净额		-710,964,505.90	-460,434,831.83
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		3,393,002,000.00	
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		7,159,962,000.00	22,100,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		10,552,964,000.00	22,100,000,000.00
偿还债务支付的现金		6,959,962,000.00	7,913,738,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,885,867,433.84	657,970,143.21
支付其他与筹资活动有关的现金			22,892,664.37
筹资活动现金流出小计		8,845,829,433.84	8,594,600,807.58
筹资活动产生的现金流量净额		1,707,134,566.16	13,505,399,192.42
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		1,714,260.88	1,162,645.34
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-5,567,932,637.60	12,154,548,061.54
加：期初现金及现金等价物余额		26,573,368,824.16	14,418,820,762.62
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	15.07	21,005,436,186.56	26,573,368,824.16

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

**合并所有者权益变动表**  
2016 年 1-12 月

单位:元 币种:人民币

项目	本期									
	归属于母公司所有者权益							少数股东权益	所有者权益合计	
	股本	资本公积	减： 库存股	其他综合收益	专项 储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
一、上年期末余额	2,700,000,000	8,564,676,213.93		345,269,489.80		518,669,879.51	1,364,956,056.45	3,046,345,459.70	212,451,766.62	16,752,368,866.01
加：会计政策变更										
前期差错更正										
同一控制下企业合并										
其他										
二、本年期初余额	2,700,000,000	8,564,676,213.93		345,269,489.80		518,669,879.51	1,364,956,056.45	3,046,345,459.70	212,451,766.62	16,752,368,866.01
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	300,000,000.00	3,199,326,672.54		-410,362,732.58		148,664,968.56	307,083,359.44	142,540,178.38	49,597,651.95	3,736,850,098.29
（一）综合收益总额				-410,362,732.58				1,498,288,506.38	20,217,194.19	1,108,142,967.99
（二）所有者投入和减少资本	300,000,000.00	3,199,326,672.54							36,113,591.46	3,535,440,264.00
1. 股东投入的普通股	300,000,000.00	3,093,002,000.00							66,350,000.00	3,459,352,000.00
2. 其他权益工具持有者投入资本										
3. 股份支付计入所有者权益的金额										
4. 其他		106,324,672.54							-30,236,408.54	76,088,264.00
（三）利润分配						148,664,968.56	307,083,359.44	-1,355,748,328.00	-6,733,133.70	-906,733,133.70
1. 提取盈余公积						148,664,968.56		-148,664,968.56		
2. 提取一般风险准备							307,083,359.44	-307,083,359.44		
3. 对所有者（或股东）的分配								-900,000,000.00	-6,733,133.70	-906,733,133.70
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	3,000,000,000.00	11,764,002,886.47		-65,093,242.78		667,334,848.07	1,672,039,415.89	3,188,885,638.08	262,049,418.57	20,489,218,964.30

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



(五) 专项储备										
1. 本期提取										
2. 本期使用										
(六) 其他										
四、本期期末余额	2,700,000,000.00	8,564,676,213.93		345,269,489.80		518,669,879.51	1,364,956,056.45	3,046,345,459.70	212,451,766.62	16,752,368,866.01

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

母公司所有者权益变动表  
2016 年 1-12 月

单位：元 币种：人民币

项目	本期								
	股本	资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	2,700,000,000.00	8,563,640,848.19		410,093,725.87		518,669,879.51	1,283,170,657.84	2,763,189,156.40	16,238,764,267.81
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	2,700,000,000.00	8,563,640,848.19		410,093,725.87		518,669,879.51	1,283,170,657.84	2,763,189,156.40	16,238,764,267.81
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	300,000,000.00	3,093,002,000.00		-423,925,864.04		148,664,968.56	297,329,937.12	140,654,779.97	3,555,725,821.61
（一）综合收益总额				-423,925,864.04				1,486,649,685.65	1,062,723,821.61
（二）所有者投入和减少资本	300,000,000.00	3,093,002,000.00							3,393,002,000.00
1. 股东投入的普通股	300,000,000.00	3,093,002,000.00							3,393,002,000.00
2. 其他权益工具持有者投入资本									
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									
（三）利润分配						148,664,968.56	297,329,937.12	-1,345,994,905.68	-900,000,000.00
1. 提取盈余公积						148,664,968.56		-148,664,968.56	
2. 提取一般风险准备							297,329,937.12	-297,329,937.12	
3. 对所有者（或股东）的分配								-900,000,000.00	-900,000,000.00
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转									
1. 资本公积转增资本（或股本）									
2. 盈余公积转增资本（或股本）									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 其他									
（五）专项储备									

1. 本期提取									
2. 本期使用									
(六) 其他									
四、本期期末余额	3,000,000,000.00	11,656,642,848.19		-13,832,138.17		667,334,848.07	1,580,500,594.96	2,903,843,936.37	19,794,490,089.42

项目	上期								
	股本	资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	2,700,000,000.00	8,563,640,848.19		300,333,321.64		252,801,672.22	751,434,243.26	1,239,611,705.37	13,807,821,790.68
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	2,700,000,000.00	8,563,640,848.19		300,333,321.64		252,801,672.22	751,434,243.26	1,239,611,705.37	13,807,821,790.68
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）				109,760,404.23		265,868,207.29	531,736,414.58	1,523,577,451.03	2,430,942,477.13
（一）综合收益总额				109,760,404.23				2,658,682,072.90	2,768,442,477.13
（二）所有者投入和减少资本									
1. 股东投入的普通股									
2. 其他权益工具持有者投入资本									
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									
（三）利润分配						265,868,207.29	531,736,414.58	-1,135,104,621.87	-337,500,000.00
1. 提取盈余公积						265,868,207.29		-265,868,207.29	
2. 提取一般风险准备							531,736,414.58	-531,736,414.58	
3. 对所有者（或股东）的分配								-337,500,000.00	-337,500,000.00
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转									
1. 资本公积转增资本（或股本）									
2. 盈余公积转增资本（或股本）									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 其他									
（五）专项储备									
1. 本期提取									
2. 本期使用									
(六) 其他									
四、本期期末余额	2,700,000,000.00	8,563,640,848.19		410,093,725.87		518,669,879.51	1,283,170,657.84	2,763,189,156.40	16,238,764,267.81

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 附注 1、公司基本情况

### 1. 公司概况

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

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

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

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

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

2015 年 11 月 16 日经公司 2015 年第四次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 23 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2015]3035 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 30,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 30,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 300,000 万元。

公司住所：苏州工业园区星阳街 5 号。

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

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

截至2016年12月31日止，本公司设立了16家分公司，并拥有证券营业部130家，均为经批准设立的分公司及证券营业部。

截至2016年12月31日，公司（包括纳入合并范围内子公司）在职员工2663人，其中母公司高级管理人员8人。

本财务报告经本公司董事会于2017年4月6日批准报出。

## 2. 合并财务报表范围

本公司2016年度纳入合并财务报表范围的子公司共18户，具有控制权的结构化主体39只；有关子公司及结构化主体的情况参见本附注7“在其他主体中的权益”。合并财务报表范围的变化情况详见本附注6“合并范围的变更”。

## 附注 2、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

#### （1）财务报表的编制方法

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

#### （2）财务报表的编制基础

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

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

## 2. 持续经营

本公司已评价自报告期末起至少 12 个月的持续经营能力，本公司管理层相信公司能自本财务报表批准日后不短于 12 个月的可预见未来期间内持续经营。因此，本公司以持续经营为基础编制截至 2016 年 12 月 31 日止的财务报表。

## 附注 3、重要会计政策、会计估计

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

### 1、遵循企业会计准则的声明

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

### 2、会计期间

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

### 3、营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

### 4、记账本位币

本公司采用人民币为记账本位币。

### 5、同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

#### (1) 同一控制下企业合并

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

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

## (2) 非同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下企业合并。购买方支付的合并成本是为取得被购买方控制权而支付的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。购买方在购买日对合并成本进行分配，确认所取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值。合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉（参见附注 3：3.22）；合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。

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

## 6、合并财务报表的编制方法

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，包括本公司及本公司的子公司（指被本公司控制的主体，包括企业、被投资单位中可分割部分、以及企业所控制的结构化主体等）。控制，是指拥有对被投资单位的权力，通过参与被投资单位的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资单位的权力影响其回报金额。子公司的经营成果、财务状况和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

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

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

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

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

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

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

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

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

## 7、合营安排的分类及共同经营的会计处理方法

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

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

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

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

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

## 8、现金及现金等价物

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

## 9、外币业务和外币报表折算

### （1）外币交易的会计处理

发生外币交易时，采用按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的汇率折算。于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，除根据借款费用核算方法应予资本化的，计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算。

### （2）外币财务报表的折算

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

## 10、金融工具的核算方法



### (1) 金融资产和金融负债的分类

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

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

#### 1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债

包括交易性金融资产和交易性金融负债，以及公司指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债。

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

只有符合以下条件之一的金融资产或金融负债，才可在初始确认时被直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债：

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

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

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

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

#### 2、持有至到期投资

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

如公司将尚未到期的某项持有至到期投资在本会计年度内出售或重分类为可供出售金融资产，其金额占全部持有至到期投资在出售或重分类前总额的 5%时，其剩余部分也重分类为可供出售金

融资产，且在本会计年度及以后两个完整的会计年度内不得再将该金融资产划分为持有至到期投资。但是，下列情况除外：

①出售日或重分类日距离该项投资到期日或赎回日较近（如到期前三个月内），市场利率变化对该项投资的公允价值没有显著影响。

②根据合同约定的定期偿付或提前还款方式收回该投资几乎所有初始本金后，将剩余部分予以出售或重分类。

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

### 3、贷款和应收款项

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

### 4、可供出售金融资产

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

### 5、其他金融负债

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

## (2) 金融资产和金融负债的确认、终止确认和计量方法

### 1、确认和终止确认：

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。

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

### 2、初始计量：

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

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

### 3、后续计量：

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

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

③贷款和应收款项按摊余成本计量，占用期间按实际利率法确认收益。

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

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

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

### (3) 金融资产和金融负债公允价值的确定

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

#### 1、公允价值确定的基本原则：

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

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

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

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

## 2、公允价值层次：

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

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

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

第三层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

### (4) 金融资产减值

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

#### 1、可供出售金融资产：

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

对于公司于中国证券金融股份有限公司设立的专户投资，鉴于该投资的特殊性，即公司无法控制中国证券金融股份有限公司运用该等出资进行投资的方式以及可收回该等出资的时间，并结合行业惯例等其他相关因素，公司以“公允价值下跌幅度超过其持有成本的 50%，或持续下跌时间在 36 个月以上”，作为该投资计提减值准备的标准。

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

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

可供出售金融资产发生减值时，即使该金融资产没有终止确认，原直接计入所有者权益（其他综合收益）的因公允价值下降形成的累计损失，应当予以转出，计入当期损益。该转出的累计

损失，为可供出售金融资产的初始取得成本扣除已收回本金和已摊销金额、当前公允价值和原已计入损益的减值损失后的余额。

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

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

## 2、以摊余成本计量的金融资产：

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

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

① 应收款项减值的方法，参见附注 3：3.11。

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

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

## (5) 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

1、金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

①所转移金融资产的账面价值；

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

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

①终止确认部分的账面价值；

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

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

#### （6）金融资产和金融负债的抵销

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

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

## 11、应收款项

单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项

√适用 □不适用

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

对于单项金额低于 1,000 万元的应收款项可以单独进行减值测试，确定减值损失，计提坏账准备；也可以与经单独测试后未减值的应收款项一起按类似信用风险特征划分为若干组合，再按

这些应收款项组合在资产负债表日余额的一定比例计提确定减值损失，计提坏账准备。根据应收款项组合的不同信用风险特征，按下述比例计提坏账准备：

A、信用业务类应收款项采用账龄分析法结合个别认定计提坏账准备。

①信用业务出现违约被强平后资不抵债的，参照以下比例计提：

账 龄	计提比例
6 个月以内	不低于 60%
6 个月-1 年以内	不低于 80%
1 年以上	100%

②股票质押业务，出现逾期违约且尚未平仓的，同时履约保障比例不低于 130%，参照以下比例计提：

账 龄	计提比例
1 年以内	不低于 10%
1-2 年以内	不低于 20%
2-3 年以内	不低于 40%
3 年以上	不低于 70%

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

账 龄	计提比例
3 年以内	0%
3 年以上	70%

在应收款项确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本集团将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

## 12、客户交易结算资金的核算

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

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

按买卖证券成交价的差额减去代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用后的余额增加客户交易结算资金。

### 13、承销证券业务的核算

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

(2) 承销证券结束，将承销证券款交付委托单位并确认承销手续费。

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

### 14、买入返售和卖出回购业务的核算

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

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

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

### 15、融资融券业务的核算

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

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

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

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

证券公司对客户融资融券并代理客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。



## 16、信用交易业务风险准备计提办法

公司信用交易业务，包括融资融券业务、约定购回业务和股票质押回购业务。资产负债表日对信用交易业务按比例法结合个别认定法计提风险准备，比例法按信用交易业务的类别分别计提，计提标准为融资融券业务规模(包括融出资金余额和融出证券成本)的 0.2%、约定购回业务规模的 0.3%、股票质押回购业务规模的 0.5%。

## 17、转融通业务核算办法

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

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

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

## 18、长期股权投资核算方法

### (1) 控制、共同控制、重大影响的判断标准

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

### (2) 投资成本确定

#### ①企业合并形成的长期股权投资，按以下方法确定投资成本：

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

分步实现的同一控制下企业合并，在合并日根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额，确定长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本与达到合并前长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积（资/股本溢价），资本公积不足冲减的，冲减留存收益。合并日之前持有的股权投资，

因采用权益法核算或金融工具确认和计量准则核算而确认的其他综合收益暂不进行会计处理，直至处置该项投资时采用与投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理；因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产总除净损益、其他综合收益和利润分配以外的所有者权益其他变动，暂不进行会计处理，直至处置该项投资时转入当期损益。其中，处置后的剩余股权根据本准则采用成本法或权益法核算的，其他综合收益和其他所有者权益应按比例结转，处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则进行会计处理的，其他综合收益和其他所有者权益应全部结转。

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

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

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

A、以支付现金取得的长期股权投资，按实际支付的购买价款作为投资成本。

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

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

(3) 后续计量及损益确认方法

①对子公司投资

在合并财务报表中，对子公司投资按附注 3：3.05 进行处理。

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

②对合营企业投资和对联营企业投资

对合营企业投资和对联营企业投资采用权益法核算，具体会计处理包括：

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

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

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

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

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

减值方法及减值准备计提方法参见附注 3：3.24。

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

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

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

## 19、固定资产的核算方法

### (1) 确认条件

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在取得时，按取得时的成本入账。与购买或建造固定资产有关的一切直接或间接成本，在

所购建资产达到预定可使用状态前所发生的，全部资本化为固定资产的成本。固定资产折旧采用直线法平均计算，并按固定资产的原值扣除残值和其预计使用年限制定折旧率。

## (2) 折旧方法

√适用 □不适用

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

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3：3.24。

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

## 20、在建工程的核算方法

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

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

在建工程减值方法及会计处理方法参见附注 3：3.24。

## 21、无形资产的核算办法

无形资产是指本公司拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产。

无形资产按照成本进行初始计量。

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

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

## 22、商誉的核算办法

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额。对商誉不摊销，以其成本扣除累计减值准备后的金额计量。商

誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。商誉的减值方法及会计处理方法参见附注 3、24。

### 23、长期待摊费用的核算方法

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

### 24、除金融资产外的其他资产减值

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

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

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

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

### 25、应付职工薪酬的核算方法

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

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

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

## 26、预计负债

(1) 与或有事项相关的义务同时满足下列条件的，应当确认为预计负债：

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

(2) 预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

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

在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

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

## 27、营业收入的确认原则

(1) 手续费及佣金收入

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

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

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

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

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

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

基金管理业务：在相关服务提供后，按合同约定方式确认当期收入。

## （2）投资收益

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

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

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

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

## （3）利息收入

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

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

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

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

## 28、政府补助

政府补助是指本公司从政府无偿取得货币性资产和非货币性资产，不包括政府作为所有者投入的资本。政府补助分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。本公司将所取得的用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助界定为与资产相关的政府补助；其余政府补助界定为与收益相关的政府补助。

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

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

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

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

## 29、所得税的会计处理方法

本公司采用资产负债表债务法进行所得税会计处理。

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

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

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

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

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



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

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

(1) 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；

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

### 30、经营租赁

#### (1) 租入资产

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

#### (2) 租出资产

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

### 31、利润分配

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

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

公司资本公积金不得用于弥补公司的亏损。

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

### 32、分部信息

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

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

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

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

运用上述会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，公司需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。公司管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。导致出现重大调整风险的重要会计估计和关键假设如下：

#### （1）应用会计政策过程中所作的重要判断

##### 1、金融资产的分类

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

##### 2、合并范围的确定

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

#### （2）会计估计中采用的关键假设和不确定因素

### 1、金融资产的公允价值

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

### 2、金融资产的减值

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

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

③信用交易业务风险准备：本公司在资产负债表日，对已形成风险的融资类业务所形成的债权(含融出资金、融出证券和买入返售金融资产等科目)，先按照个别认定法，单独进行减值测试，计提相应的减值准备。单独测试未发生减值的融资类债权，本公司参考同业风险事项影响及监管要求，按照融资融券业务规模(包括融出资金余额和融出证券成本)的0.2%、约定购回业务规模的0.3%、股票质押回购业务规模的0.5%计提减值准备。本公司将定期复核计提比例。

### 3、商誉减值

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

### 4、除金融资产和商誉以外的其他资产减值

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

### 5、所得税

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

### 34、重要会计政策和会计估计变更

#### (1) 会计政策变更

公司本期无重要会计政策变更事项。

#### (2) 会计估计变更

公司本期无重要会计估计变更事项

### 附注 4、税项

主要税种及税率情况

√适用 □不适用

税种	计税依据	税率
增值税	自 2016 年 5 月 1 日起，全面实施营业税改征增值税试点。依据财税[2016]36 号文规定，以销售货物、应税劳务和服务收入为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税。	6%（注）
营业税	2016 年 5 月 1 日前公司按应纳税营业额缴纳营业税，营业税税率为 5%。营业税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳营业税。根据财政部、国家税务总局财税[2006]172 号《关于证券投资基金有关营业税问题的通知》，准许证券公司上缴的证券投资基金保护基金从其营业税计税营业额中扣除。	5%
城市维护建设税	按流转税额的 7% 计征。城建税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳城建税。	7%

企业所得税	按应纳税额计征	25%
教育费附加及地方教育费附加	按流转税额	5%

注：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）、《财政部、国家税务总局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]46号）以及《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》（财税[2016]70号）等规定，自2016年5月1日起，公司实行营改增，按应税收入的6%计提销项税。

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。

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

√适用□不适用

纳税主体名称	所得税税率
本公司及本公司的境内子公司	25%
本公司的香港子公司	16.5%
本公司的新加坡子公司	17%

## 附注 5、合并财务报表项目注释

（下列项目如无特殊说明，均以2016年12月31日为截止日，金额以人民币元为货币单位）

### 1、货币资金

（1）按类别列示

项目	期末余额	期初余额
库存现金	203,241.27	138,113.95
银行存款	19,828,961,018.52	23,393,173,557.02
其中：客户存款	15,628,391,768.87	19,694,206,086.62
公司存款	4,200,569,249.65	3,698,967,470.40
其他货币资金	11,120,676.21	60,867,377.39
合计	19,840,284,936.00	23,454,179,048.36

## (2) 按币种列示

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	203,241.27	/	/	138,113.95
人民币	/	/	203,241.27	/	/	138,113.95
银行存款：	/	/	19,828,961,018.52	/	/	23,393,173,557.02
其中：自有 资金	/	/	4,200,569,249.65	/	/	3,698,967,470.40
人民币	/	/	4,087,052,060.52	/	/	3,676,423,262.32
美元	3,580,300.86	6.9370	24,836,547.07	3,135,054.42	6.4936	20,357,789.38
港元	99,139,867.87	0.8945	88,680,642.06	2,609,714.37	0.8378	2,186,418.70
客户资金	/	/	15,628,391,768.87	/	/	19,694,206,086.62
人民币	/	/	15,459,844,758.17	/	/	19,500,917,625.87
美元	21,207,980.21	6.9370	147,119,758.69	26,487,453.90	6.4936	171,998,930.65
港元	23,954,178.30	0.8945	21,427,252.01	25,411,231.93	0.8378	21,289,530.10
其他货币 资金：	/	/	11,120,676.21	/	/	60,867,377.39
人民币	/	/	11,120,676.21	/	/	60,867,377.39
合计	/	/	19,840,284,936.00	/	/	23,454,179,048.36

其中，融资融券业务：

√适用□不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有信用资金	/	/	109,790,078.94	/	/	198,042,477.17
人民币	/	/	109,790,078.94	/	/	198,042,477.17
客户信用资金	/	/	1,275,889,110.86	/	/	1,818,730,526.67
人民币	/	/	1,275,889,110.86	/	/	1,818,730,526.67

## (3) 使用受限制的货币资金

使用受限制的货币资金为纳入合并范围内的子公司东吴基金管理有限公司和上海新东吴优胜资产管理有限公司计提的一般风险准备金和保证金。截至2016年12月31日，上述风险准备金和保证金余额为人民币110,341,349.15元。

## 2、 结算备付金

√适用 □不适用

(1) 按币种列示

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有备付金：	/	/	597,118,449.68	/	/	652,974,200.89
人民币	/	/	597,118,449.68	/	/	652,974,200.89
客户备付金：	/	/	3,651,028,899.21	/	/	4,174,930,818.95
人民币	/	/	3,597,801,947.96	/	/	4,115,386,467.22
美元	7,180,646.01	6.9370	49,812,141.36	8,312,086.67	6.4936	53,975,366.00
港元	3,817,520.08	0.8945	3,414,809.89	6,647,154.13	0.8378	5,568,985.73
其中：客户信用 备付金：	/	/	462,665,746.33	/	/	690,569,579.49
人民币	/	/	462,665,746.33	/	/	690,569,579.49
合计	/	/	4,248,147,348.89	/	/	4,827,905,019.84

(2) 按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
客户备付金	3,651,028,899.21	4,174,930,818.95
公司备付金	597,118,449.68	652,974,200.89
合 计	4,248,147,348.89	4,827,905,019.84

## 3、 融出资金

√适用 □不适用

(1) 按开户性质分

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	8,220,287,034.90	10,540,671,009.34
机构	398,629,116.49	334,735,326.66
合计	8,618,916,151.39	10,875,406,336.00

(2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	758,362,552.52	1,071,539,549.47
债券	322,473.55	-
股票	22,217,423,233.76	27,969,366,018.97
基金	15,398,754.61	32,642,403.93
合计	22,991,507,014.44	29,073,547,972.37

## (3) 按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
融资融券业务融出资金	8,636,188,528.45	10,897,200,737.47
减：风险准备	17,272,377.06	21,794,401.47
融出资金净值	8,618,916,151.39	10,875,406,336.00

## (4) 按账龄分析

账 龄	期末余额			
	账面余额		风险准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
1-3 个月	5,022,072,701.01	58.15	10,044,145.40	0.20
3-6 个月	1,194,103,218.66	13.83	2,388,206.44	0.20
6 个月以上	2,420,012,608.78	28.02	4,840,025.22	0.20
合 计	8,636,188,528.45	100.00	17,272,377.06	0.20

(续上表)

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

(5) 截至 2016 年 12 月 31 日，本公司将上述融资融券业务中的部分债权收益权进行了质押式回购（参见附注 5：5.24）。

## 4、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

√适用□不适用

## (1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

期末余额						
项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计



债券	17,356,760,529.82	-	17,356,760,529.82	17,345,474,928.32	-	17,345,474,928.32
基金	1,351,212,043.99	-	1,351,212,043.99	1,361,193,151.86	-	1,361,193,151.86
股票	1,903,926,718.10	-	1,903,926,718.10	2,010,021,039.94	-	2,010,021,039.94
其他	1,157,806,414.95	-	1,157,806,414.95	1,160,930,614.02	-	1,160,930,614.02
合计	21,769,705,706.86	-	21,769,705,706.86	21,877,619,734.14	-	21,877,619,734.14
期初余额						
	公允价值			初始投资成本		
项目	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	9,273,247,541.02	-	9,273,247,541.02	8,966,375,897.81	-	8,966,375,897.81
基金	3,090,530,405.63	-	3,090,530,405.63	3,062,034,745.21	-	3,062,034,745.21
股票	1,429,284,465.98	-	1,429,284,465.98	1,354,467,835.35	-	1,354,467,835.35
其他	429,765,098.17	-	429,765,098.17	442,750,000.00	-	442,750,000.00
合计	14,222,827,510.80	-	14,222,827,510.80	13,825,628,478.37	-	13,825,628,478.37

## (2) 明细分类

项目	期末账面余额	期末初始成本	期初账面余额	期初初始成本
债券	17,356,760,529.82	17,345,474,928.32	9,273,247,541.02	8,966,375,897.81
基金	1,351,212,043.99	1,361,193,151.86	3,090,530,405.63	3,062,034,745.21
股票	1,903,926,718.10	2,010,021,039.94	1,429,284,465.98	1,354,467,835.35
理财产品	1,157,806,414.95	1,160,930,614.02	429,765,098.17	442,750,000.00
合计	21,769,705,706.86	21,877,619,734.14	14,222,827,510.80	13,825,628,478.37

(3) 截至 2016 年 12 月 31 日, 公司持有的由公司及其子公司作为管理人的结构化产品情况如下:

下:

项目	数量	初始成本	期末净值
东吴货币市场证券投资基金(东吴货币 B)	300,000,000.00	300,000,000.00	300,000,000.00
嘉兴天然气收费收益权资产支持专项计划-禾燃气 05	800,000.00	80,000,000.00	82,685,200.00
东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金	15,491,092.18	20,000,000.00	16,343,102.24
东吴优信稳健债券型证券投资基金-东吴优信 A	7,915,099.94	8,000,000.00	8,739,061.85
东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金	4,990,519.96	5,000,000.00	5,220,083.88
东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金	4,990,119.96	5,000,000.00	4,860,376.84
东吴吴鑫 2 号资产管理计划	30,000,000.00	30,000,000.00	30,720,000.00
新东吴优胜镇江交产 2 号专项资产管理计划	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00
合计	374,186,832.04	458,000,000.00	458,567,824.81

(4) 截至 2016 年 12 月 31 日, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物, 期末公允价值为 6,361,659,639.34 元, 质押到期日为 2017 年 01 月 03 日至 2017 年 03 月 27 日。

截至 2016 年 12 月 31 日, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无被用作转融通业务的担保物。

(5) 截至 2016 年 12 月 31 日, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无融出证券。

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

## 5、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具 (按类别列示)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,027,100.00	-	-
其中: 国债期货	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,027,100.00	-	-
权益衍生工具 (按类别列示)	-	-	-	-	6,996,544.22	368,524.97	-	-	-	4,378,035.00	3,620.00	5,704,972.15
其中: 股指期货	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,799,600.00	-	-
股票期权	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,578,435.00	3,620.00	1,459,450.00
权益收益互换	-	-	-	-	6,996,544.22	368,524.97	-	-	-	-	-	4,245,522.15
其他衍生工具 (按类别列示)	-	-	-	7,815,956.80	-	-	-	-	-	7,045,082.50	-	-
其中: 商品期货	-	-	-	7,815,956.80	-	-	-	-	-	7,045,082.50	-	-
合计	-	-	-	7,815,956.80	6,996,544.22	368,524.97	-	-	-	14,450,217.50	3,620.00	5,704,972.15

衍生金融工具的说明：

[注 1] 本公司进行的国债期货、股指期货和商品期货交易为每日无负债结算。于 2016 年 12 月 31 日，本公司持有的用于非套期的未到期国债期货、股指期货和商品期货合约的公允价值与本公司因参与该国债期货、股指期货和商品期货交易所确认的相关金融资产或负债相互抵销。

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

## 6、 买入返售金融资产

(1) 按金融资产种类列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	10,742,492,446.09	7,961,211,637.37
债券	6,271,397,638.46	977,824,758.87
减：减值准备	33,738,882.23	15,893,648.19
买入返售金融资产账面价值	16,980,151,202.32	8,923,142,748.05

(2) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	3,251,695,993.42	1,028,369,349.39
一个月至三个月内	1,433,123,777.06	900,609,207.56
三个月至一年内	7,581,244,394.07	4,982,924,630.42
一年以上	1,626,300,000.00	1,384,310,000.00
合计	13,892,364,164.55	8,296,213,187.37
减：风险准备	33,738,882.23	15,893,648.19
净额	13,858,625,282.32	8,280,319,539.18

(3) 按业务类别列示

项目	期末余额	期末减值准备	期初账面余额	期初减值准备
约定购回式证券	125,290,000.00	375,870.00	210,780,000.00	632,340.00
股票质押式回购	10,617,202,446.09	33,363,012.23	7,750,431,637.37	15,261,308.19
债券质押式回购	3,149,871,718.46	-	335,001,550.00	-
债券买断式回购	3,121,525,920.00	-	642,823,208.87	-
合计	17,013,890,084.55	33,738,882.23	8,939,036,396.24	15,893,648.19

(4) 买入返售业务的担保物情况

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
债券	5,213,778,656.70	981,699,240.00
股票	25,072,543,845.61	38,085,726,312.17

合 计	30,286,322,502.31	39,067,425,552.17
-----	-------------------	-------------------

注：期末买入返售业务的担保物、资产收益权受限情况参见附注 12.02。

## 7、应收款项

(1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收清算款	140,750,693.37	111,432,701.44
应收基金业务管理费	16,785,471.51	11,539,739.24
应收资产管理业务产品管理费	16,481,154.58	13,804,565.07
其他	56,495,427.89	218,748,223.07
合计	230,512,747.35	355,525,228.82
减：减值准备	12,462,306.59	21,781,752.78
应收款项账面价值	218,050,440.76	333,743,476.04

(2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	180,365,351.47	78.25	2,462,306.59	1.37	354,693,571.52	99.77	21,781,752.78	6.14
1-2 年	50,012,443.85	21.70	10,000,000.00	20.00	831,657.30	0.23	-	-
2-3 年	134,952.03	0.05	-	-	-	-	-	-
3 年以上	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	230,512,747.35	100.00	12,462,306.59	5.41	355,525,228.82	100.00	21,781,752.78	6.13

(3) 按评估方式列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提减值准备	-	-	-	-	-	-	-	-
组合计提减值准备	230,512,747.35	100.00	12,462,306.59	5.41	355,525,228.82	100.00	21,781,752.78	6.13
合计	230,512,747.35	100.00	12,462,306.59	5.41	355,525,228.82	100.00	21,781,752.78	6.13

## (4) 应收款项余额中前五名情况

单位名称	金额	账龄	占应收款项 总额比例(%)	款项性质
证券清算款	140,750,693.37	1年以内	61.06	证券清算款
张跃飞	50,000,000.00	1-2年	21.69	股票质押回购业务款
刁俐佳	1,932,761.68	1年以内	0.84	两融业务款
东吴汇天盈1号集合资产管理计划	1,513,095.87	1年以内	0.66	资产管理业务产品管理费
东吴货币市场证券投资基金	1,215,921.33	1年以内	0.53	资产管理业务产品管理费
合计	195,412,472.25		84.78	

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

## 8、 应收利息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
债券投资	603,188,966.01	197,485,280.57
存放金融同业	10,280,985.87	13,790,017.80
融资融券	58,776,654.38	57,271,513.43
买入返售	61,458,214.82	69,810,121.19
其他	9,564,861.13	18,690,880.25
合计	743,269,682.21	357,047,813.24

## 9、 存出保证金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
交易保证金	872,104,380.55	676,087,931.03
信用保证金	17,334,253.67	49,430,420.51
履约保证金	39,802,564.65	277,258,544.79
期货业务结算担保金	10,000,000.00	10,000,000.00
合计	939,241,198.87	1,012,776,896.33

其中：外币保证金

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
交易保证金：						
美元	270,000.00	6.9370	1,872,990.00	270,000.00	6.4936	1,753,272.00
港币	1,000,000.00	0.8945	894,510.00	1,000,000.00	0.8378	837,800.00

项 目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
合 计			2,767,500.00			2,591,072.00

## 10、可供出售金融资产

(1) 可供出售金融资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末				期初			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
债券	4,341,912,272.02	37,406,897.04	-	4,379,319,169.06	4,615,152,894.27	197,123,767.95	-	4,812,276,662.22
基金	12,240,546.71	2,131,876.09	1,310.48	14,371,112.32	32,241,446.71	6,381,546.49	8.31	38,622,984.89
股票	2,334,033,214.60	44,071,038.86	323,056,058.11	2,055,048,195.35	2,562,817,841.98	233,940,878.37	441,119.95	2,796,317,600.40
证券公司理财产品	340,045,678.47	-8,907,436.71	223,481.69	330,914,760.07	863,442,925.03	-55,405,689.78	453,686.69	807,583,548.56
其他理财产品	2,166,966,562.95	37,620,062.80	-	2,204,586,625.75	1,066,296,063.75	241,009,222.45	-	1,307,305,286.20
其他	3,823,170,000.00	-188,478,221.73	-	3,634,691,778.27	3,857,870,000.00	-145,529,696.68	-	3,712,340,303.32
按成本计量：								
其他股权投资	1,169,067,922.57	-	23,950,000.00	1,145,117,922.57	863,442,502.57	-	-	863,442,502.57
合计	14,187,436,197.32	-76,155,783.65	347,230,850.28	13,764,049,563.39	13,861,263,674.31	477,520,028.80	894,814.95	14,337,888,888.16

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

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

可供出售金融资产分类	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/债务工具的摊余成本	9,845,523,925.30	4,341,912,272.02	14,187,436,197.32
公允价值	9,384,730,394.33	4,379,319,169.06	13,764,049,563.39
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	-101,161,959.67	28,055,172.78	-73,106,786.89
已计提减值金额	347,230,850.28	-	347,230,850.28

(3) 报告期内可供出售金融资产减值的变动情况

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

可供出售金融资产分类	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
期初已计提减值金额	894,814.95	-	894,814.95
本年计提	346,592,508.62	-	346,592,508.62
其中：从其他综合收益转入	-	-	-
本年减少	256,473.29	-	256,473.29
其中：期后公允价值回升转回	-	-	-
期末已计提减值金额	347,230,850.28	-	347,230,850.28

(4) 按投资品种类别列示

项 目	期末余额	期初余额
债券	4,379,319,169.06	4,812,276,662.22
基金	14,372,422.80	38,622,993.20
股票	2,378,104,253.46	2,796,758,720.35
证券公司理财产品	331,138,241.76	808,037,235.25
其他理财产品	2,204,586,625.75	1,307,305,286.20
其他股权投资	1,169,067,922.57	863,442,502.57
其他[注]	3,634,691,778.27	3,712,340,303.32
减：减值准备	347,230,850.28	894,814.95
可供出售金融资产账面价值	13,764,049,563.39	14,337,888,888.16

[注]于2016年12月31日，可供出售金融资产包含本公司与其他若干家证券公司投资于中国证券金融股份有限公司（以下简称“中证金”）设立的专户投资，根据本公司与中证金签订的相关合同，本公司分别于2015年7月6日和2015年9月1日出资人民币2,278,350,000.00元和人民币781,070,000.00元投入该专户。该专户由本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分享投资收益，由中证金进行统一运作与投资。于2016年12月31日，本公司根据中证金提供的资产报告确定期末账面价值。

(5) 可供出售金融资产中已融出证券情况

项 目	期末余额	期初余额
股票	10,507,646.51	169,874.70



项 目	期末余额	期初余额
基金	646,249.03	4,288.40
合 计	11,153,895.54	174,163.10

## (6) 客户因融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
资金	14,862,141.07	415,007.08
股票	20,800,730.10	510,341.10
基金	1,119,123.19	223.20
合 计	36,781,994.36	925,571.38

(7) 截至 2016 年 12 月 31 日，公司持有的由公司作为管理人的东吴集合资产管理计划情况如下：

项 目	数量	初始成本	期末净值
东吴财富 1 号集合资产管理计划	2,770,337.23	1,675,222.92	3,218,023.73
东吴财富 2 号基金优选集合资产管理计划	1,499,877.07	1,499,877.07	1,566,471.61
东吴康得新 1 号集合资产管理计划	50,000,000.00	50,000,000.00	50,180,000.00
东吴期货盈衡财富常熟 1 号集合资产管理计划优先级	8,200,000.00	8,200,000.00	8,459,120.00
东吴期货火车头 5 号集合资产管理计划	5,000,000.00	5,000,000.00	5,568,500.00
东吴期货莫非投资 2 号集合资产管理计划	7,000,000.00	7,000,000.00	6,588,400.00
东吴期货达润 1 号集合资产管理计划优先级	4,000,000.00	4,000,000.00	4,300,800.00
东吴期货月光渔夫 2 号集合资产管理计划	1,000,000.00	1,000,000.00	869,000.00
东吴期货轩泰衡常 1 号集合资产管理计划优先级	10,000,000.00	10,000,000.00	10,006,000.00
东吴期货轩泰衡常 2 号集合资产管理计划优先级	5,000,000.00	5,000,000.00	5,197,500.00
东吴期货轩泰衡常 3 号集合资产管理计划优先级	7,000,000.00	7,000,000.00	7,276,500.00
合 计	101,470,214.30	100,375,099.99	103,230,315.34

## (8) 存在限售条件的可供出售金融资产明细

股票名称	证券代码	限售期截至日	锁定数量	期末公允价值
蓝丰生化	002513	2019 年 02 月 25 日	4,681,647	54,260,288.73
江苏银行	600919	2017 年 08 月 01 日	7,528,568	31,619,985.60
坚朗五金	002791	2017 年 03 月 28 日	53,384	2,484,491.36
凯莱英	002821	2017 年 11 月 17 日	3,403	148,132.59
安控科技	300370	2017 年 09 月 12 日	8,620,689	79,655,166.36
维宏股份	300508	2017 年 04 月 18 日	3,127	285,026.05
万林股份	603117	2017 年 09 月 05 日	5,179,768	85,414,374.32
苏州科达	603660	2017 年 11 月 30 日	5,067	50,365.98
百合花	603823	2017 年 12 月 19 日	10,180	114,423.20
合 计			26,085,833	254,032,254.19

(9) 截至 2016 年 12 月 31 日, 可供出售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物, 期末公允价值为 2,298,556,377.90 元, 质押到期日为 2017 年 01 月 03 日至 2017 年 03 月 27 日。

(10) 截至 2016 年 12 月 31 日, 可供出售金融资产中无被用作转融通业务的担保物。

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

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

## 11、 融券业务情况

√适用 □不适用

(1) 按来源分

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	11,153,895.54	174,163.10
—可供出售金融资产	11,153,895.54	174,163.10
其中: 股票	10,507,646.51	169,874.70
基金	646,249.03	4,288.40
—转融通融入证券	-	-
转融通融入证券总额	-	-

(2) 本期融券业务无违约情况。

## 12、 持有至到期投资

(1) 持有至到期投资情况

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额	期末公允价值
债券	6,537,008.19	34,700,915.22	6,971,528.64
其中: 企业债券	6,537,008.19	6,562,820.19	6,971,528.64
公司债券	-	28,138,095.03	-
政府债券	-	-	-
金融债券	-	-	-
其他	3,071,835.62	11,103,246.57	3,071,835.62
持有至到期投资合计	9,608,843.81	45,804,161.79	10,043,364.26
减: 持有至到期投资减值准备	-	-	-
持有至到期投资账面价值	9,608,843.81	45,804,161.79	10,043,364.26

(2) 本期公司无出售但尚未到期的持有至到期投资情况。

(3) 期末持有至到期投资为子公司东吴期货有限公司和东吴基金管理有限公司持有, 截至 2016 年 12 月 31 日, 持有至到期投资中债券被用作卖出回购等业务的质押物, 期末公允价值为 6,971,528.64 元, 质押到期日为 2017 年 1 月 3 日。

## 13、长期股权投资

√适用□不适用

## (1) 长期股权投资明细情况

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
许昌市绿野农业科技有限公司[注 1]	6,551,596.08			-233.38						6,551,362.70	
华元恒道（上海）投资管理有限公司[注 1]	39,922,376.59			2,029,488.27						41,951,864.86	
东吴在线（苏州）金融科技服务有限公司[注 2]	75,758,549.53			17,129,395.53	3,076,349.13	112,000,000.00				207,964,294.19	
苏州资产管理有限公司		240,000,000.00		-63,443.91						239,936,556.09	
小计	122,232,522.20	240,000,000.00	-	19,095,206.51	3,076,349.13	112,000,000.00	-	-	-	496,404,077.84	-
合计	122,232,522.20	240,000,000.00	-	19,095,206.51	3,076,349.13	112,000,000.00	-	-	-	496,404,077.84	-

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

[注 2] 东吴在线（苏州）金融科技服务有限公司系由本公司全资子公司东吴创新资本管理有限公司投资。

## (2) 按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
联营企业	496,404,077.84	122,232,522.20
合营企业	-	-
小 计	496,404,077.84	122,232,522.20
减：减值准备	-	-
合 计	496,404,077.84	122,232,522.20

## (3) 联营企业基本情况

单位：万元

被投资单位	企业类型	注册地	法定代表人	业务性质	注册资本	本企业持股比例 (%)	本企业在被投资单位表决权比例 (%)	期末资产总额	期末负债总额	期末净资产总额	本期营业收入总额	本期净利润
许昌市绿野农业科技有限公司	有限公司	许昌	吴桐	农产品的种植及销售 (不含粮油销售)	1,590.00	35.00	35.00	1,584.42	-0.19	1,584.61	-	-0.07
华元恒道(上海)投资管理有限公司	有限公司	上海	曲直	股权投资管理	20,500.00	19.51	19.51	21,949.05	178.59	21,770.46	303.41	1,040.23
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	有限公司	苏州	李健	网络技术服务	25,000.00	32.00	32.00	116,861.37	51,872.53	64,988.84	11,639.79	5,048.20
苏州资产管理有限公司	有限公司	苏州	赵琨	投资管理、投资咨询	120,000.00	20.00	20.00	120,054.61	86.33	119,968.28	-	-31.72

联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

## 14、固定资产

(1) 固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	运输工具	办公设备及其他	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	707,071,313.37	24,726,541.28	384,948,140.69	1,116,745,995.34
2. 本期增加金额	-	537,307.00	58,229,744.46	58,767,051.46
(1) 购置	-	-	58,229,744.46	58,229,744.46
(2) 其他增加	-	537,307.00	-	537,307.00
3. 本期减少金额	14,692,597.21	1,782,515.00	6,048,800.20	22,523,912.41
(1) 处置或报废	-	-	-	-
(2) 清理报废	14,692,597.21	1,782,515.00	6,048,800.20	22,523,912.41
4. 期末余额	692,378,716.16	23,481,333.28	437,129,084.95	1,152,989,134.39
二、累计折旧				
1. 期初余额	85,339,961.20	13,142,101.35	207,494,931.10	305,976,993.65
2. 本期增加金额	22,413,422.30	2,606,438.08	55,925,267.25	80,945,127.63
(1) 计提	22,413,422.30	2,095,996.43	55,925,267.25	80,434,685.98
(2) 其他增加	-	510,441.65	-	510,441.65
3. 本期减少金额	-	1,207,481.37	5,851,597.61	7,059,078.98
4. 期末余额	107,753,383.50	14,541,058.06	257,568,600.74	379,863,042.30
三、减值准备				
1. 期初余额	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-
(1) 计提	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-
(1) 处置或报废	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	-	-
四、账面价值				
1. 期末账面价值	584,625,332.66	8,940,275.22	179,560,484.21	773,126,092.09
2. 期初账面价值	621,731,352.17	11,584,439.93	177,453,209.59	810,769,001.69

- (2) 固定资产期末余额中无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提固定资产减值准备。
- (3) 期末固定资产无抵押担保情况。
- (4) 本期减少固定资产主要原因为清理报废设备。
- (5) 本期增加的固定资产中无借款费用资本化金额。
- (6) 期末无暂时闲置的固定资产。
- (7) 期末无通过融资租赁租入的固定资产。
- (8) 期末通过经营租赁租出的固定资产情况如下表：

项目	账面原值	累计折旧	账面净值
房屋建筑物	4,527,551.96	2,816,245.15	1,711,306.81

- (9) 期末无持有待售的固定资产。
- (10) 期末无未办妥产权证书的固定资产情况。

## 15、在建工程

- (1) 在建工程情况  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

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

## (2) 在建工程项目变动情况

项 目	资金来源	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
				本期转入固定资产	其他减少	
装修工程	自筹	751,888.44	340,188.00	-	1,092,076.44	-
合 计	-	751,888.44	340,188.00	-	1,092,076.44	-
减：减值准备	-	-	-	-	-	-
在建工程账面价值	-	751,888.44	340,188.00	-	1,092,076.44	-

(3) 截至 2016 年 12 月 31 日，上述装修工程已完工，工程资金来源均为自筹。

(4) 公司在建工程本期发生额中无利息资本化支出。

## 16、无形资产

(1) 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	卫星建站费	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	104,423,670.70	152,222,544.82	14,307,917.10	415,600.00	271,369,732.62
2. 本期增加金额	-	42,813,675.76	-	-	42,813,675.76
(1) 购置	-	42,813,675.76	-	-	42,813,675.76
(2) 其他增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
(1) 处置	-	-	-	-	-
(2) 其他减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	104,423,670.70	195,036,220.58	14,307,917.10	415,600.00	314,183,408.38

二、累计摊销					
1. 期初余额	18,757,001.69	75,238,545.12	13,887,083.83	415,600.00	108,298,230.64
2. 本期增加金额	2,610,591.84	25,265,147.82	50,000.04	-	27,925,739.70
(1) 计提	2,610,591.84	25,265,147.82	50,000.04	-	27,925,739.70
(2) 其他增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
(1) 处置	-	-	-	-	-
(2) 其他减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	21,367,593.53	100,503,692.94	13,937,083.87	415,600.00	136,223,970.34
三、减值准备					
1. 期初余额	-	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	-	-	-
四、账面价值					
1. 期末账面价值	83,056,077.17	94,532,527.64	370,833.23	-	177,959,438.04
2. 期初账面价值	85,666,669.01	76,983,999.70	420,833.27	-	163,071,501.98

(2) 期末无形资产无抵押担保情况。



## 17、商誉

(1) 商誉账面原值

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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

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

[注 2] 公司通过非同一控制下企业合并取得东吴基金管理有限公司和东吴期货有限公司的股权形成的商誉。

(2) 商誉减值准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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

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

## 18、递延所得税资产/递延所得税负债

### (1) 未经抵销的递延所得税资产

√适用□不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	410,704,416.16	102,676,104.04	60,364,617.39	15,091,154.36
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	124,045,957.09	31,011,489.28	-	-
可供出售金融资产公允价值变动	144,801,050.99	36,200,262.75	-	-
尚未支付的职工薪酬	978,030,869.07	244,507,717.29	1,457,787,928.10	364,446,982.02
衍生金融工具	-	-	4,345,610.15	1,086,402.54
其他	29,234,601.81	7,308,650.48	39,122,758.93	9,780,689.74
合计	1,686,816,895.12	421,704,223.84	1,561,620,914.57	390,405,228.66

### (2) 未经抵销的递延所得税负债

√适用□不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	594,944.35	148,736.08	313,713,246.83	78,428,311.72
可供出售金融资产公允价值变动	5,189,347.40	1,297,336.85	477,520,028.80	111,089,953.64
衍生金融工具	7,589,064.22	1,897,266.06	115,207.00	28,801.75
其他	88,060,536.39	22,015,134.10	140,234,520.81	43,172,987.25
合计	101,433,892.36	25,358,473.09	931,583,003.44	232,720,054.36

### (3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债:

√适用□不适用

单位:元 币种:人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	3,352,292.35	418,351,931.49	223,102,991.73	167,302,236.93
递延所得税负债	3,352,292.35	22,006,180.74	223,102,991.73	9,617,062.63

## 19、其他资产

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	62,324,311.95	68,892,306.83
待摊费用	12,939,688.53	9,038,703.09
应收款项类投资		400,000,000.00
长期待摊费用	28,508,952.63	28,487,140.99
其他长期资产	97,626,608.00	182,776,608.00
其他	35,353,870.11	9,403,965.46
合计	236,753,431.22	698,598,724.37

(2) 其他应收款

①按明细列示

项目	期末余额	期初余额
其他应收款余额	62,324,311.95	68,892,306.83
减：坏账准备	-	-
其他应收款净值	62,324,311.95	68,892,306.83

②其他应收款按种类分析

种类	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款	36,041,500.00	57.83	-	-	36,041,500.00
按组合计提坏账准备的其他应收款					
组合一	24,917,380.68	39.98	-	-	24,917,380.68
组合小计	24,917,380.68	39.98	-	-	24,917,380.68
单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款	1,365,431.27	2.19	-	-	1,365,431.27
合计	62,324,311.95	100.00	-	-	62,324,311.95

(续上表)

种类	期初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款	36,041,500.00	52.32	-	-	36,041,500.00
按组合计提坏账准备的其他应收款					
组合一	32,083,692.57	46.57	-	-	32,083,692.57
组合小计	32,083,692.57	46.57	-	-	32,083,692.57
单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款	767,114.26	1.11	-	-	767,114.26

种类	期初余额				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
合计	68,892,306.83	100.00	-	-	68,892,306.83

③组合中，按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款：

项目	期末余额		
	其他应收款	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	22,138,790.16	-	-
1-2 年	2,354,179.05	-	-
2-3 年	424,411.47	-	-
3 年以上	-	-	-
合计	24,917,380.68	-	-

(续上表)

项目	期初余额		
	其他应收款	坏账准备	计提比例 (%)
1 年以内	28,108,672.94	-	-
1-2 年	2,679,174.14	-	-
2-3 年	1,295,845.49	-	-
3 年以上	-	-	-
合计	32,083,692.57	-	-

④期末其他应收款中主要项目

单位名称	金额	账龄	占其他应收款 总额比例 (%)	款项性质
张家港市中昊房地产有限公司	36,041,500.00	3 年以上	57.83	预付购房款
上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司	3,111,877.77	1 年以内	4.99	房租押金
陈郁萍、陈启中、陈怡翔	1,376,000.00	1 年以内	2.21	房屋押金
北京鑫景通达置业有限公司	959,293.20	2 年以内	1.54	房屋租赁保证金
陈宁	816,280.00	1 年以内	1.31	房屋租赁保证金
合计	42,304,950.97		67.88	

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

(3) 待摊费用

项目	期末余额	期初余额
房租	11,643,969.62	8,239,219.19
数据线路费	991,979.18	-
咨询费	52,329.05	79,532.50
其他	251,410.68	719,951.40

合 计	12,939,688.53	9,038,703.09
-----	---------------	--------------

## (4) 长期待摊费用

2016 年度增减变动:

项目	取得方式	原始金额	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
					本期摊销	其他减少	
装修费	购入	54,937,822.39	23,460,335.22	10,574,304.33	10,310,509.60	-	23,724,129.95
网络工程	购入	2,632,229.18	1,756,011.23	342,120.61	845,996.73	-	1,252,135.11
办公家具	购入	6,893,499.15	2,295,299.93	1,331,323.83	911,476.56	-	2,715,147.20
水电增容	购入	734,539.55	181,438.10	54,772.83	150,396.94	-	85,813.99
消防工程	购入	2,330,571.37	794,056.51	298,425.85	360,755.98	-	731,726.38
合计		67,528,661.64	28,487,140.99	12,600,947.45	12,579,135.81	-	28,508,952.63

## (5) 其他长期资产

项 目	期末余额	期初余额
河南金利福珠宝有限公司	50,000,000.00	40,000,000.00
江阴盛凯环保设备有限公司	10,000,000.00	10,000,000.00
成都支付通新信息有限公司	20,300,000.00	20,300,000.00
山东联创节能新材料股份有限公司	-	50,000,000.00
苏州名城信息港发展有限公司	1,500,000.00	4,546,608.00
苏州奥杰汽车技术股份有限公司	-	850,000.00
湘村高科农业股份有限公司	-	9,630,000.00
深圳市联赢激光股份有限公司	-	5,000,000.00
成都好房通科技有限公司	4,546,608.00	3,000,000.00
安徽白兔湖动力股份有限公司	-	2,200,000.00
浙江东阳中广影视文化有限公司	9,000,000.00	9,000,000.00
江苏国贸领智能科技股份有限公司	-	4,100,000.00
武汉颂大教育科技股份有限公司	-	13,500,000.00
盘古基因生物工程(南京)股份有限公司	-	4,950,000.00
广州优蜜移动科技股份有限公司	2,280,000.00	5,700,000.00
合 计	97,626,608.00	182,776,608.00

上述款项为本公司支付的新三板做市业务增资预付款。

## 20、资产减值准备变动表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
			转回	转销	
买入返售金融资产减值准备	15,893,648.19	17,845,234.04	-	-	33,738,882.23
坏账准备	21,781,752.78	-9,151,618.44	-	167,827.75	12,462,306.59

可供出售金融资产减值准备	894,814.95	346,592,508.62	-	256,473.29	347,230,850.28
融出资金减值准备	21,794,401.47	-	4,522,024.41	-	17,272,377.06
商誉减值准备	15,361,400.00	-	-	-	15,361,400.00
合计	75,726,017.39	355,286,124.22	4,522,024.41	424,301.04	426,065,816.16

## 21、短期借款

### (1) 短期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款[注]	10,964,512.50	13,684,509.36
保证借款	-	50,000,000.00
信用借款	170,000,000.00	30,000,000.00
合计	180,964,512.50	93,684,509.36

[注] 系子公司东吴期货有限公司的质押借款，质押物为郑州商品交易所标准仓单。

## 22、应付短期融资款

### (1) 分类情况

项目	期末余额	期初余额
短期融资券	-	2,500,000,000.00
收益凭证[注]	3,880,000,000.00	2,067,350,000.00
合计	3,880,000,000.00	4,567,350,000.00

[注] 公司于本期共发行 20 期期限小于一年的收益凭证，未到期产品的收益率为 3.35%至 6.40%。

### (2) 短期融资券明细

债券名称	发行日期	到期日期	票面利率
15 东吴证券 CP005	2015 年 11 月 04 日	2016 年 02 月 04 日	2.89%
15 东吴证券 CP006	2015 年 11 月 24 日	2016 年 02 月 24 日	3.20%
15 东吴证券 CP007	2015 年 12 月 11 日	2016 年 03 月 11 日	3.13%
16 东吴证券 CP001	2016 年 04 月 15 日	2016 年 07 月 15 日	2.95%

(续上表)

债券名称	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
15 东吴证券 CP005	500,000,000.00	-	500,000,000.00	-
15 东吴证券 CP006	1,000,000,000.00	-	1,000,000,000.00	-
15 东吴证券 CP007	1,000,000,000.00	-	1,000,000,000.00	-
16 东吴证券 CP001	-	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	-
合计	2,500,000,000.00	1,500,000,000.00	4,000,000,000.00	-

### (3) 收益凭证明细

债券名称	起息日	到期日	票面利率
东吴证券固定收益凭证双喜 9 号	2015 年 04 月 21 日	2016 年 04 月 19 日	6.00%

债券名称	起息日	到期日	票面利率
东吴证券固定收益凭证双喜 15 号	2015 年 08 月 12 日	2016 年 02 月 10 日	5.00%
东吴证券固定收益凭证双喜 16 号	2015 年 10 月 29 日	2016 年 10 月 24 日	4.80%
东吴证券固定收益凭证双喜 17 号	2015 年 12 月 10 日	2016 年 06 月 07 日	4.60%
东吴证券固定收益凭证双喜 18 号	2015 年 12 月 17 日	2016 年 06 月 14 日	4.40%
东吴证券固定收益凭证双喜 19 号	2015 年 12 月 24 日	2016 年 06 月 21 日	4.50%
东吴证券固定收益凭证双喜 20 号	2015 年 12 月 24 日	2016 年 12 月 23 日	4.30%
东吴证券固定收益凭证双喜 22 号	2016 年 01 月 14 日	2016 年 07 月 13 日	4.20%
东吴证券固定收益凭证融通[201504]号	2015 年 12 月 03 日	2016 年 04 月 07 日	4.38%
东吴证券固定收益凭证融通[201505]号	2015 年 12 月 25 日	2016 年 02 月 02 日	3.95%
东吴证券固定收益凭证融通[201602]号	2016 年 07 月 15 日	2016 年 10 月 18 日	3.80%
东吴证券固定收益凭证融通[201603]号	2016 年 07 月 26 日	2016 年 10 月 28 日	3.40%
东吴证券固定收益凭证融通[201604]号	2016 年 09 月 13 日	2017 年 03 月 17 日	3.50%
东吴证券固定收益凭证融通[201605]号	2016 年 11 月 15 日	2017 年 08 月 10 日	3.35%
东吴证券固定收益凭证融通[201606]号	2016 年 12 月 02 日	2017 年 03 月 02 日	3.80%
东吴证券固定收益凭证融通[201607]号	2016 年 12 月 05 日	2017 年 05 月 30 日	3.85%
东吴证券固定收益凭证融通[201608]号	2016 年 12 月 28 日	2017 年 03 月 29 日	6.40%
东吴至尊宝新手礼第 1 期收益凭证	2016 年 04 月 08 日	2016 年 05 月 09 日	6.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201501]号	2015 年 10 月 30 日	2016 年 05 月 09 日	5.00%
东吴创新固定收益凭证稳信[201501]号	2015 年 11 月 19 日	2016 年 06 月 01 日	5.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201502]号	2015 年 11 月 24 日	2016 年 05 月 09 日	4.80%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201503]号	2015 年 11 月 24 日	2016 年 05 月 24 日	4.80%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201504]号	2015 年 11 月 24 日	2016 年 08 月 15 日	5.10%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201505]号	2015 年 12 月 24 日	2016 年 08 月 29 日	5.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201506]号	2015 年 12 月 25 日	2016 年 09 月 12 日	4.90%
东吴创新固定收益凭证稳信[201601]号	2016 年 03 月 04 日	2016 年 09 月 07 日	4.50%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201601]号	2016 年 04 月 12 日	2017 年 04 月 13 日	4.40%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201602]号	2016 年 05 月 05 日	2016 年 09 月 22 日	4.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201603]号	2016 年 05 月 05 日	2016 年 09 月 28 日	4.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201604]号	2016 年 05 月 20 日	2017 年 05 月 22 日	4.20%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201605]号	2016 年 06 月 22 日	2017 年 06 月 22 日	4.20%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201606]号	2016 年 06 月 22 日	2017 年 07 月 12 日	4.20%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201607]号	2016 年 07 月 21 日	2017 年 07 月 26 日	4.30%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201608]号	2016 年 09 月 06 日	2017 年 03 月 22 日	4.00%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201609]号	2016 年 09 月 06 日	2017 年 03 月 22 日	3.70%
东吴创新固定收益凭证稳盈[201610]号	2016 年 08 月 28 日	2016 年 12 月 28 日	3.50%

(续上表)

债券名称	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
------	------	------	------	------

东吴证券固定收益凭证双喜 9 号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 15 号	150,000,000.00	-	150,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 16 号	200,000,000.00	-	200,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 17 号	200,000,000.00	-	200,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 18 号	200,000,000.00	-	200,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 19 号	200,000,000.00	-	200,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 20 号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证双喜 22 号	-	150,000,000.00	150,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201504]号	300,000,000.00	-	300,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201505]号	50,000,000.00	-	50,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201602]号	-	300,000,000.00	300,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201603]号	-	500,000,000.00	500,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201604]号	-	500,000,000.00	-	500,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201605]号	-	800,000,000.00	-	800,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201606]号	-	800,000,000.00	-	800,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201607]号	-	400,000,000.00	-	400,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201608]号	-	700,000,000.00	-	700,000,000.00
东吴至尊宝新手礼第 1 期收益凭证		9,962,000.00	9,962,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201501]号	50,050,000.00	-	50,050,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳信[201501]号	14,300,000.00	-	14,300,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201502]号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201503]号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201504]号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201505]号	103,000,000.00	-	103,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201506]号	100,000,000.00	-	100,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳信[201601]号	-	140,000,000.00	140,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201601]号	-	100,000,000.00	-	100,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201602]号	-	50,000,000.00	50,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201603]号	-	100,000,000.00	100,000,000.00	-
东吴创新固定收益凭证稳盈[201604]号	-	100,000,000.00	-	100,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201605]号	-	90,000,000.00	-	90,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201606]号	-	90,000,000.00	-	90,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201607]号	-	200,000,000.00	-	200,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201608]号	-	50,000,000.00	-	50,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201609]号	-	50,000,000.00	-	50,000,000.00
东吴创新固定收益凭证稳盈[201610]号	-	50,000,000.00	50,000,000.00	-
合计	2,067,350,000.00	5,179,962,000.00	3,367,312,000.00	3,880,000,000.00



**23、拆入资金**

√适用 □不适用

(1) 分类情况

单位：元 币种：人民币

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

(2) 其中转融通融入资金情况

项目	期末余额	利率	期初余额	利率
一个月内	-		-	-
一个月至三个月内	-		250,000,000.00	6.30%
三个月至一年内	-		-	
一年以上	-		-	
合计	-		250,000,000.00	

**24、卖出回购金融资产款**

(1) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	9,044,945,793.82	6,706,452,635.46
资产收益权	1,780,000,000.00	2,220,000,000.00
合计	10,824,945,793.82	8,926,452,635.46

(2) 报价回购融入资金按剩余期限分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	55,735,000.00	1.25%-2.0%	141,936,000.00	1.2%-2.0%
一个月至三个月内	1,174,000.00		4,975,000.00	
三个月至一年内	-		-	
一年以上	-		-	
合计	56,909,000.00		146,911,000.00	

(3) 按业务类别列示

项目	期末余额	期初余额
报价回购融入资金	56,909,000.00	146,911,000.00
质押式回购融入资金	5,459,170,191.00	4,496,324,951.20
买断式回购融入资金	3,528,866,602.82	2,063,216,684.26
资产收益权	1,780,000,000.00	2,220,000,000.00
合计	10,824,945,793.82	8,926,452,635.46

(4) 担保物信息

截至 2016 年 12 月 31 日，卖出回购金融资产款的担保物公允价值为人民币 12,496,373,797.46 元(2015 年：10,409,127,568.85 元)。

## 25、代理买卖证券款

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	14,884,075,443.46	21,038,335,118.66
机构	4,682,472,327.77	2,987,643,261.60
合计	19,566,547,771.23	24,025,978,380.26

代理买卖证券款的说明：

(1) 按客户列示

项目	期末余额	期初余额
普通经纪业务	18,110,658,660.37	21,767,247,853.59
个人	13,609,509,119.09	18,803,680,307.97
机构	4,501,149,541.28	2,963,567,545.62
信用业务	1,455,889,110.86	2,258,730,526.67
个人	1,274,566,324.37	2,234,654,810.69
机构	181,322,786.49	24,075,715.98
合计	19,566,547,771.23	24,025,978,380.26

(2) 按币种列示

项目	期末余额		期初余额	
	外币金额	折人民币金额	外币金额	折人民币金额
普通经纪业务	-	18,110,658,660.37	-	21,767,247,853.59
人民币	-	17,886,117,198.39	-	21,511,823,969.13
美元	28,658,626.22	198,804,890.09	35,069,540.57	227,727,568.64
港币	28,771,698.38	25,736,571.89	33,058,386.06	27,696,315.82
信用业务	-	1,455,889,110.86	-	2,258,730,526.67
人民币	-	1,455,889,110.86	-	2,258,730,526.67
美元	-	-	-	-
港币	-	-	-	-
合计	-	19,566,547,771.23	-	24,025,978,380.26

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

## 26、应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示：

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,503,308,661.79	848,791,685.16	1,317,415,389.14	1,034,684,957.81
二、离职后福利-设定提	2,181,065.32	71,214,131.19	70,608,706.71	2,786,489.80

存计划				
三、辞退福利	-	419,530.37	419,530.37	-
四、一年内到期的其他福利	-	-	-	-
合计	1,505,489,727.11	920,425,346.72	1,388,443,626.22	1,037,471,447.61

(2) 短期薪酬列示:

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,495,128,858.98	731,101,576.36	1,201,161,322.82	1,025,069,112.52
二、职工福利费	-	24,864,612.74	24,864,612.74	-
三、社会保险费	405,287.69	32,537,189.52	32,511,447.75	431,029.46
其中: 医疗保险费	351,787.13	29,980,163.86	29,956,985.94	374,965.05
工伤保险费	30,133.97	1,000,286.24	1,023,524.03	6,896.18
生育保险费	23,366.59	1,556,739.42	1,530,937.78	49,168.23
四、住房公积金	438,552.00	38,778,776.20	38,772,618.20	444,710.00
五、工会经费和职工教育经费	7,335,963.12	21,293,873.59	19,889,730.88	8,740,105.83
六、短期带薪缺勤	-	-	-	-
七、短期利润分享计划	-	-	-	-
八、其他	-	215,656.75	215,656.75	-
合计	1,503,308,661.79	848,791,685.16	1,317,415,389.14	1,034,684,957.81

(3) 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	918,594.43	65,557,402.53	65,428,068.59	1,047,928.37
2、失业保险费	62,470.89	3,366,728.66	3,390,638.12	38,561.43
3、企业年金缴费	1,200,000.00	2,290,000.00	1,790,000.00	1,700,000.00
合计	2,181,065.32	71,214,131.19	70,608,706.71	2,786,489.80

(4) 期末应付职工薪酬中无拖欠性质的款项。

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

(6) 本公司 2016 年度实际发放的高级管理人员薪酬为人民币 693.26 万元。

## 27、应交税费

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	13,762,219.34	-1,370,115.90
营业税	-	41,796,932.34
企业所得税	171,452,013.92	326,737,359.50
个人所得税	15,094,794.55	27,026,109.97
城市维护建设税	964,980.34	2,955,753.38
教育费附加	697,565.84	2,150,741.89
股民利息税	2,071,260.65	349,083.45
其他税费	1,860,651.82	1,837,686.79
合计	205,903,486.46	401,483,551.42

**28、 应付款项**

应付款项列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款	240,828,720.40	453,732.14
应付佣金	22,183,382.20	23,541,770.76
应付第三方存管费	15,315,463.47	18,690,142.00
应付收益互换业务款项	24,888,957.53	19,793,068.49
其他	7,380,572.89	7,926,827.03
合计	310,597,096.49	70,405,540.42

**29、 应付利息**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
客户资金	2,278,695.54	2,545,451.01
短期借款	206,708.26	-
拆入资金	-	4,725,000.00
其中：转融通融入资金	-	4,725,000.00
应付债券	512,282,613.64	471,987,148.96
卖出回购	29,175,431.46	39,197,334.63
应付短期融资款	27,457,828.78	18,248,463.07
合计	571,401,277.68	536,703,397.67

**30、 应付债券**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	发行日期	债券期限	发行金额	票面利率	期末余额	期初余额
13 东吴债	3,000,000,000.00	2013-11-18	五年期	3,000,000,000.00	6.18%	2,987,767,656.08	2,981,385,324.62
15 东吴债	2,500,000,000.00	2015-11-09	五年期	2,500,000,000.00	4.15%	2,493,846,732.30	2,492,233,800.74
15 东吴 01 证券 次级债	3,000,000,000.00	2015-03-23	三年期	3,000,000,000.00	5.90%	2,997,558,391.14	2,995,554,743.80
15 东吴 02 证券 次级债	3,000,000,000.00	2015-04-17	三年期	3,000,000,000.00	5.90%	2,998,710,767.39	2,997,708,942.57
15 东吴 03 证券 次级债一期	2,000,000,000.00	2015-06-01	三年期	2,000,000,000.00	5.70%	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
15 东吴 03 证券 次级债二期	2,000,000,000.00	2015-06-04	三年期	2,000,000,000.00	5.70%	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
东吴证券固定 收益凭证融通 [201501]号	500,000,000.00	2015-05-14	两年期	500,000,000.00	6.35%	500,000,000.00	500,000,000.00
东吴证券固定 收益凭证融通 [201502]号	500,000,000.00	2015-05-15	一年期	500,000,000.00	6.05%	-	500,000,000.00
东吴证券固定 收益凭证融通 [201601]号	1,500,000,000.00	2016-07-12	一年期	1,500,000,000.00	3.65%	1,500,000,000.00	-
合计	18,000,000,000.00			18,000,000,000.00		17,477,883,546.91	16,466,882,811.73

债券名称	期初余额	本期净增加	折溢价摊销	本期偿还	期末余额
13 东吴债	2,981,385,324.62	-	6,382,331.46	-	2,987,767,656.08
15 东吴债	2,492,233,800.74	-	1,612,931.56	-	2,493,846,732.30

债券名称	期初余额	本期净增加	折溢价摊销	本期偿还	期末余额
15 东吴 01 证券次级债	2,995,554,743.80	-	2,003,647.34	-	2,997,558,391.14
15 东吴 02 证券次级债	2,997,708,942.57	-	1,001,824.82	-	2,998,710,767.39
15 东吴 03 证券次级债一期	2,000,000,000.00	-	-	-	2,000,000,000.00
15 东吴 03 证券次级债二期	2,000,000,000.00	-	-	-	2,000,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201501]号	500,000,000.00	-	-	-	500,000,000.00
东吴证券固定收益凭证融通[201502]号	500,000,000.00	-	-	500,000,000.00	-
东吴证券固定收益凭证融通[201601]号	-	1,500,000,000.00	-	-	1,500,000,000.00
合计	16,466,882,811.73	1,500,000,000.00	11,000,735.18	500,000,000.00	17,477,883,546.91

[注]公司于本期共发行 1 期期限大于一年的收益凭证，产品收益率为 3.65%。

### 31、其他负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	112,317,581.86	107,715,945.41
预提费用	41,820,388.84	59,596,382.62
应付期货投资者保障基金	363,909.06	283,118.75
合并结构化主体形成的其他负债	14,618,487,767.49	6,668,165,287.03
股权转让预收款	11,535,000.00	9,375,000.00
代理兑付证券款	-	19,092.10
应付股利	3,275,231.39	-
应付票据	50,265,700.00	-
期货风险准备金	33,506,494.97	29,252,292.36
其他	37,821,052.42	2,607,961.07
合计	14,909,393,126.03	6,877,015,079.34

其他负债的说明：

#### (1) 预提费用

项目	期末余额	期初余额
证券投资者保护基金[注]	20,913,353.62	26,975,665.72
广告费	12,186,561.52	19,250,000.00
证券经纪人报酬	6,246,993.65	10,704,703.13
三方存管费	-	1,353,150.42
房租	60,239.18	715,302.35
其他	2,413,240.87	597,561.00
合计	41,820,388.84	59,596,382.62

[注]证券投资者保护基金系公司根据中国证监会证监发[2007]50号文《关于印发〈证券公司缴纳证券投资者保护基金实施办法（试行）〉的通知》、中国证监会机构部部函[2007]

268 号文《关于发布实施〈证券公司分类监管工作指引（试行）〉的通知》按营业收入的一定比例计提，2016 年和 2015 年计提比例均为 1.00%。

(2) 期货风险准备金按期货手续费收入的 5% 计提。

(3) 其他应付款

项 目	期末余额		期初余额	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
其他应付款	112,317,581.86	100.00	107,715,945.41	100.00
其中：逾期应付款项	-	-	-	-
合 计	112,317,581.86	100.00	107,715,945.41	100.00

期末其他应付款主要明细：

内 容	金额	账龄	款项性质
员工风险金[注]	65,515,183.48	部分 3 年以上	员工风险金
经纪人风险金	7,455,017.29	部分 3 年以上	经纪人风险金
恒生电子股份有限公司	7,199,675.21	部分 3 年以上	恒生投资交易管理系统软件费
中国银行代销佣金	6,004,924.82	1 年以内	代销佣金
福建顶点软件股份有限公司	2,230,000.00	2 年以内	顶点系统软件费用
合 计	88,404,800.80		

[注] 员工风险金将按照公司相关制度规定考核后于满足条件年度返还。

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

(5) 应付期货投资者保障基金

项 目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
应付期货投资者保障基金[注]	283,118.75	1,212,491.78	1,131,701.47	363,909.06
合 计	283,118.75	1,212,491.78	1,131,701.47	363,909.06

[注] 应付期货投资者保障基金按代理交易额的千万分之六点五计提。

## 32、股本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减（+、-）					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	2,700,000,000.00	300,000,000.00				300,000,000.00	3,000,000,000.00

其他说明：

项 目	期初余额	本期变动增 (+) 减 (-)			期末余额
		本期增加	本期减少	小计	
一、有限售条件股份					
1、国有法人股	109,000,000.00	209,000,000.00	-	209,000,000.00	318,000,000.00
2、社会法人股	-	91,000,000.00		91,000,000.00	91,000,000.00
小 计	109,000,000.00	300,000,000.00	-	300,000,000.00	409,000,000.00
二、无限售条件股份					
1、人民币普通股	2,591,000,000.00	-	-	-	2,591,000,000.00
小 计	2,591,000,000.00	-	-	-	2,591,000,000.00
合 计	2,700,000,000.00	300,000,000.00	-	300,000,000.00	3,000,000,000.00

### 33、资本公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价） [注1]	8,563,640,848.19	3,093,002,000.00	5,675,327.46	11,650,967,520.73
其他资本公积[注2]	1,035,365.74	112,000,000.00	-	113,035,365.74
合 计	8,564,676,213.93	3,205,002,000.00	5,675,327.46	11,764,002,886.47

[注 1] 本期增加系公司境内发行人民币普通股，实际募集资金净额为 3,393,002,000.00 元，扣除股本 300,000,000.00 元，差额 3,093,002,000.00 元计入资本公积—股本溢价。本期减少系东吴证券股份有限公司收购东吴期货有限公司 4% 少数股权，购买成本与按取得的股权比例计算的子公司净资产份额的差额。

[注 2] 本期增加系根据《企业会计准则第 2 号—长期股权投资》相关规定，公司联营企业东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司接受其他股东资本性投入产生的资本溢价，按公司期末所持股权比例计算享有的份额。

## 34、其他综合收益

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上期金额
1. 可供出售金融资产产生的利得（损失）金额	-380,987,664.59	416,069,426.58
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	-99,390,842.59	95,727,303.11
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	126,086,110.89	209,389,880.95
其他	10,439,854.54	20,919,829.75
小计	-418,122,787.43	90,032,412.77
2. 按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额	3,076,349.13	-
减：按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额产生的所得税影响	-	-
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小计	3,076,349.13	
3. 现金流量套期工具产生的利得（或损失）金额		
减：现金流量套期工具产生的所得税影响		
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
转为被套期项目初始确认金额的调整额		
小计		
4. 外币财务报表折算差额	5,343,670.21	152,654.63
减：处置境外经营当期转入损益的净额	-	-
小计	5,343,670.21	152,654.63
5. 其他		
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响		
前期其他计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小计		
合计	-409,702,768.09	90,185,067.40

其他综合收益说明：



项目	期初余额	本期发生金额						期末余额
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	其他	
以后将重分类进损益的其他综合收益	345,269,489.80	-372,567,645.25	126,086,110.89	-99,390,842.59	-410,362,732.58	659,964.49	10,439,854.54	-65,093,242.78
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	-	3,076,349.13	-	-	3,076,349.13	-	-	3,076,349.13
可供出售金融资产公允价值变动损益	345,154,998.83	-380,987,664.59	126,086,110.89	-99,390,842.59	-418,261,785.72	138,998.29	10,439,854.54	-73,106,786.89
持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益	-	-	-	-	-	-	-	-
现金流量套期损益的有效部分	-	-	-	-	-	-	-	-
外币财务报表折算差额	114,490.97	5,343,670.21	-	-	4,822,704.01	520,966.20	-	4,937,194.98
其他综合收益合计	345,269,489.80	-372,567,645.25	126,086,110.89	-99,390,842.59	-410,362,732.58	659,964.49	10,439,854.54	-65,093,242.78

(续上表)

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

项 目	期初余额	上期发生金额					期末余额	
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东		其他
部分								
外币财务报表折算差额	-	152,654.63	-	-	114,490.97	38,163.66	-	114,490.97
其他综合收益合计	255,204,488.79	416,222,081.21	209,389,880.95	95,727,303.11	90,065,001.01	120,066.39	20,919,829.75	345,269,489.80

**35、 盈余公积**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	518,669,879.51	148,664,968.56	-	667,334,848.07
合计	518,669,879.51	148,664,968.56	-	667,334,848.07

**36、 一般风险准备**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	本期减少	期末余额
一般风险准备	731,452,704.24	158,418,390.88	-	889,871,095.12
交易风险准备	633,503,352.21	148,664,968.56	-	782,168,320.77
合计	1,364,956,056.45	307,083,359.44	-	1,672,039,415.89

**37、 未分配利润**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	3,046,345,459.70	1,485,436,624.61
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）	-	-
调整后期初未分配利润	3,046,345,459.70	1,485,436,624.61
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88
减：提取法定盈余公积[注1]	148,664,968.56	265,868,207.29
提取一般风险准备[注1]	307,083,359.44	544,217,859.50
普通股股利[2]	900,000,000.00	337,500,000.00
期末未分配利润	3,188,885,638.08	3,046,345,459.70

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

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

[注 2] 2016 年 5 月 21 日，公司 2015 年年度股东大会决议通过 2015 年度利润分配方案：以 30 亿股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 3 元（含税），共计派发股利 9 亿元（含税）。

## 38、少数股东权益

项目	本期发生额	上期发生额
期初少数股东权益	212,451,766.62	154,524,217.52
加：所有者投入资本	36,113,591.46	36,375,360.00
归属于少数股东的净利润	19,557,229.70	24,798,122.71
归属于少数股东的其他综合收益	659,964.49	120,066.39
减：利润分配	6,733,133.70	3,366,000.00
期末少数股东权益	262,049,418.57	212,451,766.62

## 39、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入	3,231,004,803.10	4,629,644,638.37
证券经纪业务	1,548,650,853.64	3,356,030,532.30
其中：代理买卖证券业务	1,446,845,542.98	3,290,889,176.15
交易单元席位租赁	85,587,849.47	53,878,036.36
代销金融产品业务	16,217,461.19	11,263,319.79
期货经纪业务	156,087,287.73	71,082,792.11
投资银行业务	911,506,287.45	765,676,414.50
其中：证券承销业务	557,957,273.96	460,931,235.93
证券保荐业务	43,028,301.60	35,375,000.00
财务顾问业务	310,520,711.89	269,370,178.57
资产管理业务	227,041,842.72	211,023,414.19
基金管理业务	110,089,887.09	131,468,141.60
投资咨询业务	254,639,754.91	61,119,237.42
其他	22,988,889.56	33,244,106.25
手续费及佣金支出	429,067,867.34	808,035,479.91
证券经纪业务	404,574,623.26	780,859,201.04
其中：代理买卖证券业务	404,574,623.26	780,859,201.04
交易单元席位租赁	-	-
代销金融产品业务	-	-
期货经纪业务	-	-
投资银行业务	14,545,303.90	8,120,000.00
其中：证券承销业务	3,623,864.15	4,250,000.00
证券保荐业务	-	-
财务顾问业务	10,921,439.75	3,870,000.00
资产管理业务	6,435,543.02	4,347,682.86
基金管理业务	-	-
投资咨询业务	96,599.15	-
其他	3,415,798.01	14,708,596.01
手续费及佣金净收入	2,801,936,935.76	3,821,609,158.46
其中：财务顾问业务净收入	299,599,272.14	265,500,178.57
— 并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	39,950,000.00	25,610,000.00
— 并购重组财务顾问业务净收入—其他	-	-
— 其他财务顾问业务净收入	259,649,272.14	239,890,178.57

## (2) 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品 业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	2,461,660,370.42	5,474,031.00	4,375,388,805.42	5,780,225.80
资产管理计划	48,568,431,982.22	10,743,430.19	64,367,588,850.93	5,483,093.99
合计	51,030,092,352.64	16,217,461.19	68,742,977,656.35	11,263,319.79

## (3) 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	34.00	323.00	136.00
期末客户数量	3,241.00	323.00	1,917.00
其中：个人客户	3,173.00	15.00	1,732.00
机构客户	68.00	308.00	185.00
期初受托资金	5,460,097,246.25	190,886,608,584.47	34,853,297,636.01
其中：自有资金投入	100,419,214.30	-	113,000,000.00
个人客户	3,722,509,959.57	296,800,000.00	5,058,025,923.68
机构客户	1,637,168,072.38	190,589,808,584.47	29,682,271,712.33
期末受托资金	8,671,659,525.92	251,642,028,265.49	50,150,288,919.70
其中：自有资金投入	76,470,214.30	-	27,950,000.00
个人客户	2,912,038,905.58	533,605,990.00	5,543,649,519.61
机构客户	5,683,150,406.04	251,108,422,275.49	44,578,689,400.09
期末主要受托资产初始成本	8,954,535,231.41	251,141,303,399.73	50,248,393,151.07
其中：股票	703,392,945.64	7,998,264,906.85	5,668,746,005.30
国债	-	-	2,615,850.00
其他债券	4,842,511,825.36	6,782,246,705.98	2,551,638,118.87
基金	449,221,044.56	1,759,148,306.75	350,612,860.25
信托	1,950,339,453.48	31,484,019,420.70	7,473,000,000.00
票据	-	4,931,561,483.40	-
理财	-	44,210,022,162.46	-
买入返售	354,316,030.50	22,250,780,575.22	158,585,160.46
委托贷款	-	28,717,496,000.00	4,424,900,000.00
收益权	-	95,068,275,848.37	24,350,195,156.19
协议或定期存款	422,117,415.89	7,914,810,000.00	3,000,000,000.00
股权投资	39,121,010.00	24,582,000.00	2,268,100,000.00
期货投资	193,515,505.98	95,990.00	-
当期资产管理业务净收入	35,917,230.54	92,119,293.00	92,569,776.16

## 40、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	2,077,173,199.16	2,399,648,330.19
存放金融同业利息收入	513,789,329.24	667,146,513.79
其中：自有资金存款利息收入	143,905,739.43	189,893,762.10
客户资金存款利息收入	369,883,589.81	477,252,751.69
融资融券利息收入	695,485,913.23	1,033,083,498.19
买入返售金融资产利息收入	828,931,756.03	672,126,805.90
其中：约定购回利息收入	15,313,166.68	25,581,442.57
股权质押回购利息收入	748,339,969.05	309,454,219.36
拆出资金利息收入	27,777.78	-

其他	38,938,422.88	27,291,512.31
利息支出	1,884,903,302.11	2,113,092,778.70
客户资金存款利息支出	76,649,547.94	98,156,310.99
卖出回购金融资产利息支出	289,678,808.85	779,712,802.23
其中：报价回购利息支出	1,387,657.00	4,803,399.82
短期借款利息支出	1,417,989.58	4,118,197.94
拆入资金利息支出	3,413,472.22	101,775,889.34
其中：转融通利息支出	3,237,500.00	100,574,794.43
应付债券利息支出	953,366,551.80	643,337,704.39
应付短期融资款利息支出	116,332,125.70	122,613,628.19
其他	444,044,806.02	363,378,245.62
利息净收入	192,269,897.05	286,555,551.49

#### 41、投资收益

√适用□不适用

##### (1) 投资收益明细情况

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	19,095,206.51	2,643,966.52
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	1,711,197,768.43	2,381,332,785.50
其中：持有期间取得的收益	1,274,180,172.87	704,217,093.41
-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	747,985,038.79	320,150,168.67
-持有至到期投资	1,483,232.23	19,489,687.43
-可供出售金融资产	524,711,901.85	364,577,237.31
-衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	437,017,595.56	1,677,115,692.09
-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	104,669,927.30	862,794,632.20
-持有至到期投资		
-可供出售金融资产	326,871,194.26	841,871,006.19
-衍生金融工具	5,476,474.00	-27,549,946.30
其他		
合计	1,730,292,974.94	2,383,976,752.02

##### (2) 对联营企业和合营企业的投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
许昌绿野农业科技有限公司	-233.38	-233.25	-
华元恒道(上海)投资管理有限公司	2,029,488.27	6,885,650.24	被投资单位利润减少
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	17,129,395.53	-4,241,450.47	被投资单位利润增加
苏州资产管理有限公司	-63,443.91	-	本期新增被投资单位
合计	19,095,206.51	2,643,966.52	

(3) 公司投资收益汇回无重大限制情况。

#### 42、公允价值变动收益 / (损失)

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-505,113,059.71	290,458,733.83
衍生金融工具	9,931,321.61	16,169,836.85

合计	-495,181,738.10	306,628,570.68
----	-----------------	----------------

**43、其他业务收入、成本**

项 目	本期发生额	上期发生额
<b>其他业务收入</b>		
其中：出租收入	7,266,113.90	3,176,362.86
投资咨询收入	939,937.10	7,141,085.62
贸易收入	401,864,095.13	12,318,085.61
其他	3,162,331.35	7,593,713.24
合 计	413,232,477.48	30,229,247.33
<b>其他业务成本</b>		
其中：贸易成本	402,896,451.27	12,433,685.30
合 计	402,896,451.27	12,433,685.30

**44、税金及附加**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
营业税	82,992,418.22	370,216,237.31
城市维护建设税	18,327,088.21	25,719,727.31
教育费附加	13,140,549.38	18,594,711.25
房产税	5,096,210.93	
印花税	2,168,418.56	
其他税费	1,053,506.97	160,903.62
合 计	122,778,192.27	414,691,579.49

**45、业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工工资	731,101,576.36	1,787,754,814.11
社会保险费	101,443,670.80	94,053,624.85
租赁费及物业费	90,386,313.78	72,745,000.65
固定资产折旧费	80,432,187.48	76,613,119.99
咨询费	61,462,209.14	39,047,011.76
业务开发费	54,569,817.25	54,024,830.17
宣传广告费	46,454,977.88	55,213,664.90
住房公积金	38,778,776.20	33,773,992.94
投资者保护基金	37,035,835.12	65,164,112.59
电子设备运转费	35,158,581.66	29,922,803.28
其他	554,297,420.68	347,786,048.18
合 计	1,831,121,366.35	2,656,099,023.42

**46、资产减值损失**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
一、坏账损失	-9,151,618.44	21,781,752.78
二、存货跌价损失		
三、可供出售金融资产减值损失	346,570,949.77	-
四、持有至到期投资减值损失		
五、长期股权投资减值损失		
六、投资性房地产减值损失		
七、固定资产减值损失		
八、工程物资减值损失		
九、在建工程减值损失		
十、生产性生物资产减值损失		
十一、油气资产减值损失		
十二、无形资产减值损失		
十三、商誉减值损失		
十四、信用交易风险准备[注]	13,344,768.48	1,015,273.09
合计	350,764,099.81	22,797,025.87

[注]本期融出资金转回减值准备 4,522,024.41 元，融出证券计提减值准备 21,558.85 元，买入返售金融资产计提减值准备 17,845,234.04 元，本期合计计提信用交易风险准备 13,344,768.48 元。

#### 47、营业外收入

营业外收入情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计	6,528.31	120,365.63	6,528.31
其中：固定资产处置利得	6,528.31	120,365.63	6,528.31
政府补助	25,933,136.96	18,492,164.47	25,933,136.96
违约金收入	41,090,055.57	-	-
其他	511,944.49	287,699.41	511,944.49
合计	67,541,665.33	18,900,229.51	26,451,609.76

计入当期损益的政府补助

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额
中关村科技园区管理委员会划入改制上市券商补助	-	200,000.00
徐州市财政局财政经费补助新三板挂牌奖励资金	400,000.00	400,000.00
南通苏通科技产业园区管理委员会房租综合补贴	-	284,000.00
常州新北区财政局金融产业发展基金	573,000.00	539,000.00
苏州市园区国库支付金融产业扶持基金		3,000,000.00
上海市黄浦区财政局产业扶持资金	7,060,000.00	3,380,000.00
徐州市财政局金融业专项补贴	20,000.00	500,000.00
苏州园区国库支付中心先进集体表彰	50,000.00	-
吴中区 2015 年度综合表彰大会专项奖励资金	200,000.00	-
昆山花桥经济开发区办公用房租金补贴	170,000.00	-
上海市政府金融办支持区域内重点产业企业发展扶助资金	2,050,000.00	-
失业保险稳岗补贴	1,417,812.07	-
中山小榄政府产业扶持奖励	30,000.00	-



郑州市政府重点产业发展扶持资金	200,000.00	-
昆山花桥经济开发区入驻奖励	12,270,000.00	9,730,000.00
税收返还	1,466,888.26	319,164.47
其他	25,436.63	140,000.00
合计	25,933,136.96	18,492,164.47

#### 48、营业外支出

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	386,197.09	1,628,127.84	386,197.09
其中：固定资产处置损失	386,197.09	1,628,127.84	386,197.09
对外捐赠	1,318,000.00	1,589,730.00	1,318,000.00
预计负债		81,754,000.00	
计提各项基金及其他支出	4,271,075.38	802,568.09	4,271,075.38
合计	5,975,272.47	85,774,425.93	5,975,272.47

#### 49、所得税费用

(1) 所得税费用表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	567,326,264.98	1,045,829,538.29
递延所得税费用	-85,939,724.08	-121,856,148.06
合计	481,386,540.90	923,973,390.23

(2) 会计利润与所得税费用调整过程：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	1,999,232,276.98
按法定/适用税率计算的所得税费用	499,808,069.25
子公司适用不同税率的影响	-4,744,216.89
调整以前期间所得税的影响	-11,569,132.85
非应税收入的影响	-13,719,974.81
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	9,438,547.41
其他	2,173,248.79
所得税费用	481,386,540.90

#### 50、其他综合收益

√适用 □不适用

详见附注 5.34

#### 51、每股收益

(1) 基本每股收益

项目	2016 年度	2015 年度
----	---------	---------

项 目	2016 年度	2015 年度
归属于本公司普通股股东的合并净利润	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88
本公司发行在外普通股的加权平均数	2,975,000,000.00	2,700,000,000.00
基本每股收益(元/股)	0.50	1.00

## (2) 稀释每股收益

本公司不存在稀释性潜在普通股,因此稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

## 52、现金流量表项目

## (1) 收到的其他与经营活动有关的现金:

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
纳入合并的结构化产品收到其他投资者投入	7,950,322,480.46	2,692,912,490.62
政府补助	25,933,136.96	18,492,164.47
存出保证金减少	73,535,697.46	203,830,460.68
应收款项类投资收回	400,000,000.00	225,000,000.00
其他业务收入	489,722,708.12	32,751,787.02
其他	6,077,619.83	17,558,228.21
合计	8,945,591,642.83	3,190,545,131.00

## (2) 支付的其他与经营活动有关的现金:

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
应收款项类投资	-	50,000,000.00
支付的业务及管理费	752,851,719.30	525,575,603.74
投资者保护基金	43,017,356.91	51,346,630.71
其他业务成本	434,873,077.33	25,071,311.80
其他	311,451,691.17	271,783,143.41
合计	1,542,193,844.71	923,776,689.66

## (3) 收到的其他与投资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
处置固定资产收到的现金	15,846,917.08	624,092.67
合计	15,846,917.08	624,092.67

## (4) 收到的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
仓单质押	191,445,390.45	13,684,509.36
合计	191,445,390.45	13,684,509.36

## (5) 支付的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
归还少数股东投资本金	5,880,000.00	
归还质押借款	184,165,387.31	
支付的短期融资券发行费用	683,684.85	22,892,664.37
合计	190,729,072.16	22,892,664.37

**53、现金流量表补充资料**

(1) 现金流量表补充资料

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	1,517,845,736.08	2,733,293,024.59
加：资产减值准备	350,764,099.81	22,797,025.87
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	80,432,187.48	76,613,119.99
无形资产摊销	27,925,739.70	23,116,857.38
长期待摊费用摊销	12,579,135.81	17,908,931.90
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）	379,668.78	1,507,762.21
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	-	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-	-
利息支出（收益以“-”号填列）	624,421,414.37	770,087,464.22
投资损失（收益以“-”号填列）	-19,095,206.51	-2,643,966.52
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-251,049,694.56	-107,706,517.10
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	12,389,118.11	6,927,171.04
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-12,829,988,405.15	-10,785,689,297.87
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产减少	-	-
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,286,798,261.38	5,437,775,878.30
其他	-	-
经营活动产生的现金流量净额	-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>		
现金的期末余额	23,978,090,935.74	28,181,391,000.34
减：现金的期初余额	28,181,391,000.34	16,053,451,825.17
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	-4,203,300,064.60	12,127,939,175.17

(2) 现金和现金等价物的构成

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	23,978,090,935.74	28,181,391,000.34
其中：库存现金	203,241.27	138,113.95
可随时用于支付的银行存款	19,718,619,669.37	23,292,480,489.16
可随时用于支付的其他货币资金	11,120,676.21	60,867,377.39
结算备付金	4,248,147,348.89	4,827,905,019.84
二、现金等价物	-	-
三、期末现金及现金等价物余额	23,978,090,935.74	28,181,391,000.34
其中：母公司或集团内子公司使用受限的现金和现金等价物	-	-

#### 54、外币货币性项目

(1) 外币货币性项目：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	24,788,281.07	6.9370	171,956,305.76
港币	123,094,046.17	0.8945	110,107,894.07
结算备付金			
其中：美元	7,180,646.01	6.9370	49,812,141.36
港币	3,817,520.08	0.8945	3,414,809.89
存出保证金			
其中：美元	270,000.00	6.9370	1,872,990.00
港元	1,000,000.00	0.8945	894,510.00
代理买卖证券款			
美元	28,658,626.22	6.9370	198,804,890.09
港元	28,771,698.38	0.8945	25,736,571.89

(续上表)

项目	期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额
货币资金			
其中：美元	29,622,508.32	6.4936	192,356,720.03
港元	28,020,946.30	0.8378	23,475,948.80
结算备付金			
其中：美元	8,312,086.67	6.4936	53,975,366.00
港元	6,647,154.13	0.8378	5,568,985.73
存出保证金			
其中：美元	270,000.00	6.4936	1,753,272.00
港元	1,000,000.00	0.8378	837,800.00
代理买卖证券款			
其中：美元	35,069,540.57	6.4936	227,727,568.64
港元	33,058,386.06	0.8378	27,696,315.82

## 附注 6、合并范围的变更

## 1、非同一控制下企业合并

□适用 √不适用

## 2、同一控制下企业合并

□适用 √不适用

## 3、报告期新设子公司纳入合并范围的主体

名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		注册资本	取得方式
				直接	间接		
苏州东吴城市建设资产管理有限公司	苏州	苏州工业园区胜浦新路1号金雅苑1幢108 商号二楼	投资管理、资产管理、投资咨询、市场营销策划	-	100.00	2,000,000.00	设立
宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业(有限合伙)	宁波	北仑区梅山大道商务中心十一号办公楼2203 室	创业投资及相关咨询服务	-	48.00	80,000,000.00	设立
苏州工业园区东并投资管理有限公司	苏州	苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦7层722 室	投资管理、投资咨询	-	100.00	1,000,000.00	设立
东吴证券(香港)金融控股有限公司	香港	RM 1202A 12/F WING ON HOUSE NO. 71 DES VOEUX RD CENTRAL HONG KONG	投资	100.00	-	100,000,000.00 (港币)	设立
东吴(香港)投资有限公司	香港	SUITE 508, 5/F TOWER 1 SILVERCORD 30 CANTON RD TST KLN HONG KONG	投资	-	100.00	500,000,000.00 (港币)	设立
东吴国际资本有限责任公司	开曼群岛	开曼群岛	投资	-	100.00	50,000.00 (美元)	设立

## 4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	股权处置价款	股权处置比例 (%)	股权处置方式	丧失控制权的时点	丧失控制权时点的确定依据	处置价款与处置投资对应的合并财务报表层面享有该子公司净资产份额的差额	丧失控制权之日剩余股权的比例	丧失控制权之日剩余股权的账面价值	丧失控制权之日剩余股权的公允价值	按照公允价值重新计量剩余股权产生的利得或损失	丧失控制权之日剩余股权公允价值的确定方法及主要假设	与原子公司股权投资相关的其他综合收益转入投资损益的金额
苏州业联投资管理有限公司	6,404,638.00	51.00	公司注销	2016年1月26日	工商注销登记						不适用	

## 5、其他

### 纳入合并范围的结构化主体

本公司根据准则 33 号(2014) 《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》（修订），对于本公司作为管理人或投资人，且综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并，本期纳入公司合并报表范围的结构化产品共 39 只（其中有 11 只产品已于 2016 年度清算）。

## 附注 7、在其他主体中的权益

## 1、在子公司中的权益

## (1). 企业集团的构成

√适用 □不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		注册资本	取得方式
				直接	间接		
东吴期货有限公司	苏州	上海市黄浦区西藏南路 1208 号东吴证券大厦 6 楼	期货经纪、投资咨询	93.80	-	500,000,000.00	购买
上海东吴玖盈投资管理有限公司	上海	上海市黄浦区普安路 128 号 703 室 H8 座	投资管理及咨询, 实物投资等	-	100.00	100,000,000.00	设立
东吴基金管理有限公司	上海	上海浦东源深路 279 号	基金募集、销售、管理	70.00	-	100,000,000.00	购买
上海新东吴优胜资产管理有限公司	上海	上海市黄浦区九江路 769 号 1806-3 室	资产管理	-	70.00	50,000,000.00	设立
东吴创业投资有限公司	苏州	昆山花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦	创业投资、投资咨询	100.00	-	1,200,000,000.00	设立
苏州东吴城市建设资产管理有限公司	苏州	苏州工业园区胜浦新路 1 号金雅苑 1 幢 108 商号二楼	投资管理、资产管理、投资咨询、市场营销策划	-	100.00	2,000,000.00	设立
东吴创新资本管理有限责任公司	苏州	昆山花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦	投资管理、投资咨询	100.00	-	2,000,000,000.00	设立
东吴创业投资(徐州)有限责任公司	徐州	徐州市泉山区建国西路 75 号锦绣嘉园 8 号楼 1-2309 室	创业投资、投资咨询	-	100.00	10,000,000.00	设立
东吴并购资本管理(上海)有限公司	上海	上海市黄浦区西藏南路 1208 号 18 层 A 室	投资管理、投资咨询	-	100.00	20,000,000.00	设立
苏州工业园区东并投资管理有限公司	苏州	苏州工业园区星阳街 5 号 东吴证券大厦 7 层 722 室	投资管理、投资咨询	-	100.00	1,000,000.00	设立
宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业(有限合伙)	宁波	北仑区梅山大道商务中心 十一号 办公楼 2203 室	创业投资及相关咨询服务	-	48.00	80,000,000.00	设立
东吴并购股权投资基金(上海)合伙(有限合伙)	上海	上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-7 室	投资管理、投资咨询	-	100.00	318,700,000.00	设立
昆山东吴阳澄投资管理有限公司	昆山	昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房	投资管理	-	80.00	1,000,000.00	设立

昆山东吴阳澄创业投资中心（有限合伙）	昆山	昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房	投资管理、投资咨询	-	50.50	100,000,000.00	设立
东吴证券中新（新加坡）有限公司	新加坡	Robinson Road, #17-00, AIATower, Singapore 048542	投资管理	75.00	-	10,000,000.00 (新加坡元)	设立
东吴证券（香港）金融控股有限公司	香港	RM 1202A 12/F WING ON HOUSE NO. 71 DES VOEUX RD CENTRAL HONG KONG	投资	100.00	-	100,000,000.00(港币)	设立
东吴（香港）投资有限公司	香港	SUITE 508, 5/F TOWER 1 SILVERCORD 30 CANTON RD TST KLN HONG KONG	投资	-	100.00	500,000,000.00(港币)	设立
东吴国际资本有限责任公司	开曼群岛	开曼群岛	投资	-	100.00	50,000.00(美元)	设立

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位的依据：

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司间接持有宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业（有限合伙）48.00%的股权比例。根据宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业（有限合伙）的合伙协议，本公司的全资子公司东吴并购资本管理（上海）有限公司作为唯一的执行事务合伙人，可以控制合伙企业的投资决策。因此，本公司管理层认为本公司对宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业（有限合伙）具有实际控制，故采用长期股权投资成本法对其进行核算。

## (2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

子公司名称	少数股东持股比例	少数股东的表决权比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
东吴期货有限公司	6.20	6.20	2,267,237.16	2,354,456.48	33,148,709.95
东吴证券中新（新加坡）有限公司	25.00	25.00	-1,341,048.26	-	10,474,327.63
东吴基金管理有限公司	30.00	30.00	14,834,956.91	-	122,276,096.45



## (3). 重要非全资子公司的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额						期初余额					
	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计
东吴期货有限公司	2,821,359,447.91	224,115,199.27	3,045,474,647.18	2,427,101,083.62	1,041,688.90	2,428,142,772.52	1,866,138,014.06	255,903,718.57	2,122,041,732.63	1,508,486,215.18	33,892.03	1,508,520,107.21
东吴证券中新(新加坡)有限公司	42,775,493.89	117,317.25	42,892,811.14	980,830.62	-	980,830.62	45,233,596.26	-	45,233,596.26	41,287.50	-	41,287.50
东吴基金管理有限公司	324,895,565.58	91,202,846.14	416,098,411.72	76,635,604.19	-	76,635,604.19	299,853,450.70	81,634,663.56	381,488,114.26	73,429,317.37	-	73,429,317.37

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
东吴期货有限公司	622,965,404.84	36,568,341.29	40,647,079.34	780,744,253.88	188,635,445.74	47,014,265.16	47,014,265.16	-141,804,536.75
东吴证券中新(新加坡)有限公司	179.97	-5,364,193.04	-3,280,328.24	-4,788,441.63	-	-676,455.87	-523,801.24	-1,082,209.42
东吴基金管理有限公司	232,821,967.12	31,404,010.64	31,404,010.64	10,622,677.87	259,371,991.04	51,999,333.35	51,999,333.35	-923,491.11

## (4). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:

□适用 √不适用

## 2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

√适用□不适用

## (1). 在子公司所有者权益份额的变化情况的说明:

√适用 □不适用

2016 年 1 月，公司收购苏州工业园区华都物资贸易有限公司持有的东吴期货有限公司 4% 股权，截至 2016 年 12 月 31 日，公司持有东吴期货有限公司 93.8% 股权。

(2). 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响：

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	东吴期货有限公司
购买成本/处置对价	
-- 现金	30,031,736.00
-- 非现金资产的公允价值	-
购买成本/处置对价合计	30,031,736.00
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	24,356,408.54
差额	5,675,327.46
其中：调整资本公积	5,675,327.46
调整盈余公积	
调整未分配利润	

## 3、在合营企业或联营企业中的权益

√适用 □不适用

## (1). 重要的合营企业或联营企业

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	苏州	苏州	网络技术服务	-	32.00	长期股权投资

## (2). 重要联营企业的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
流动资产	449,322,552.82	137,639,166.40
非流动资产	719,291,193.65	211,026,408.00
资产合计	1,168,613,746.47	348,665,574.40
流动负债	518,015,327.14	178,303,903.07
非流动负债	710,000.00	-
负债合计	518,725,327.14	178,303,903.07
少数股东权益	-	-
归属于母公司股东权益	649,888,419.33	170,361,671.33
按持股比例计算的净资产份额	207,964,294.19	68,144,668.53
调整事项		
--商誉	-	-
--内部交易未实现利润	-	-
--其他	-	-
对联营企业权益投资的账面价值	207,964,294.19	75,758,549.53
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值	-	-
营业收入	116,397,914.15	182,197.17
净利润	50,482,026.67	-9,638,328.67
终止经营的净利润	-	-
其他综合收益	9,613,591.04	
综合收益总额	60,095,617.71	-9,638,328.67
本年度收到的来自联营企业的股利	-	-

## (3) 不重要的合营企业和联营企业的基本情况

项目	企业类型	注册地	法定代表人	业务性质	注册资本 (万元)	本企业 持股比例 (%)	本企业在被 投资单位表 决权比例(%)
联营企业:							
许昌市绿野农业科技有 限公司	有限 公司	许昌	吴桐	农产品的种植及销售 (不含粮油销售)	1,590.00	35.00	35.00
华元恒道(上 海)投资管理有 限公司	有限 公司	上海	曲直	股权投资管理	20,500.00	19.51	19.51
苏州资产管理 有限公司	有限 公司	苏州	赵琨	投资管理、投资咨询	120,000.00	20.00	20.00

## (4) 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
联营企业:		
许昌市绿野农业科技有 限公司	6,551,362.70	6,551,596.08
河南华元恒道投资管理有 限公司	41,951,864.86	39,922,376.59
苏州资产管理有限公司	239,936,556.09	-
投资账面价值合计	288,439,783.65	46,473,972.67
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	10,084,411.64	2,643,966.52
--其他综合收益		
--综合收益总额	10,084,411.64	2,643,966.52

## (5) 合营企业或联营企业发生的超额亏损

□适用 √不适用

## 4、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明:

√适用 □不适用

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明: 本公司作为结构化主体的管理者, 在报告期间对资产管理计划拥有管理权。除已于附注 7:7.05 所述本公司已合并的结构化主体外, 本公司因在结构化主体中拥有的权益而享有可变回报并不重大, 因此, 本公司并未合并该等结构化主体。

截至 2016 年 12 月 31 日，上述由本公司管理且有自有资金投入的未纳入合并范围的结构化主体的资产总额为人民币 10,189,458,730.80 元。由本公司管理但未有自有资金投入且未纳入合并范围的结构化主体的资产规模为人民币 321,773,404,405.12 元。

本期公司在上述结构化主体中的投资和获得的收入并不重大。

## 5、本公司在合并的结构化主体中的权益

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

截至 2016 年 12 月 31 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 19,964,334,465.88 元。本公司持有上述合并资产管理计划中的权益体现在资产负债表中可供出售金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的总金额为人民币 3,684,665,716.46 元。

## 6、本公司在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本公司通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括信托计划、基金与其他理财产品。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

截至 2016 年 12 月 31 日，合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本公司因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

项目	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	合计
基金	608,086,316.51	899,585,317.51	1,507,671,634.02
信托计划	-	477,174,800.00	477,174,800.00
其他理财产品	1,331,851,270.50	1,115,920,763.19	2,447,772,033.69
合计	1,939,937,587.01	2,492,680,880.70	4,432,618,467.71

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司因投资上述信托计划、基金与其他理财产品而可能遭受损失的最大风险敞口为其在报告日的公允价值。

## 附注 8、与金融工具相关的风险

√适用□不适用

### 1、风险管理政策及组织架构

#### (1) 风险管理政策

为增强公司核心竞争力，保障公司持续、健康、稳定发展，公司注重对风险的防范与控制，严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系，

包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化，以保证公司各类风险可测、可控和可承受，保障公司稳健经营和各项业务创新发展。

本公司董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。

## **(2) 风险管理组织架构**

公司建立由董事会及其风险控制委员会、公司经营管理层及其风险管理委员会、风险管理职能部门、各部门及分支机构组成的四层级全面风险管理组织架构。

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责对公司风险管理进行监督与指导，将公司总体风险控制在合理的范围内，以确保公司能够对经营活动中的风险控制实施有效的管理。董事会设立的风险控制委员会按照公司章程和工作细则的相关规定，可在董事会授权范围内履行和协助董事会履行风险管理职责。

经营管理层负责管理公司经营过程中的各类风险，推动公司全面风险管理体系的规划、建设与执行。公司经营管理层下设风险管理委员会，在经营管理层授权范围内开展公司风险管理工作。

公司设首席风险官，负责公司全面风险管理工作。风险管理职能部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。

各业务部门、分支机构在日常工作中应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

公司各子公司根据所在地法律法规和监管要求，按照公司管理政策和要求，有效开展风险管理，纳入证券公司全面风险管理。子公司董事长和总经理承担子公司风险管理直接责任。

## **2、公司面临的主要风险及应对措施**

在日常管理中，本公司面临的主要风险包括：流动性风险、信用风险、市场风险和操作风险、商誉等资产的减值风险。公司通过明确风险管理的各个环节和实施内容，采用目标设定、事件识别、风险评估、风险应对、控制活动、信息沟通与报告等的全面风险管理基本工作方法，科学有效地开展公司的风险管理工作。

### **(1) 流动性风险管理**

流动性风险是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。

主要包括两个方面：一是资产的流动性风险，是指由于资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产造成损失的风险；二是负债的流动性风险，是指公司缺乏现金不能按时支付债务或正常营业支出的风险。

本公司已建立并健全了资金业务的风险评估和监测制度，重点做好自有资金的合理安排，严格控制资金流动性风险，使各项资金比例严格控制在公司可承受风险范围之内。在资金需求方面，主要体现为日常运营资金需求、自营股票投资需求、固定资产采购与对外投资、债券投资和债券回购等，报告期内公司密切关注市场变化，动态调整资产配置，合理控制各品种证券的投资规模和持仓集中度，剩余期限分布合理，流动性风险不大。同时，公司的融资渠道主要有公司债券、短期融资券、质押回购、拆入资金等，能够满足公司日常运营所需资金以及融资融券等资本密集型业务快速增长所需要的资金，因此有能力支付可预见的到期债务或承诺。在流动性日常管理和风控指标监测方面，公司每日编制资金头寸表、汇总短期资金预约表、进行日间资金盯市、完成自营业务交收工作；按月计算和报送流动性覆盖率、净稳定资金率；编制公司现金流预测表，关注资金缺口并进行资金预警；定期分析公司资金使用状况，流动比率、资产错配比率等指标；对流动性覆盖率、净稳定资金率动态监测并定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况。

随着未来公司业务的快速发展，将对流动性提出更高要求。为满足上述情况带来的挑战，公司将不断完善流动性管理的制度建设、风险防范机制，在监管允许范围之内，努力拓宽融资渠道，合理安排负债结构，努力保持较强的偿债能力，积极提高各项业务的盈利水平和可持续发展能力。于资产负债表日，本公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

## 2016 年年度报告

金融负债	2016 年 12 月 31 日							
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	合计
短期借款	-	7,877,524.84	1,174,613.19	178,525,413.72	-	-	-	187,577,551.75
应付短期融资款	-	13,887,150.68	2,123,003,397.26	1,797,661,589.04	-	-	-	3,934,552,136.98
衍生金融负债	368,524.97	-	-	-	-	-	-	368,524.97
卖出回购金融资产款	-	8,631,304,381.74	953,774,587.06	1,278,250,904.11	-	-	-	10,863,329,872.91
代理买卖证券款	19,566,547,771.23	-	-	-	-	-	-	19,566,547,771.23
应付款项	310,597,096.49	-	-	-	-	-	-	310,597,096.49
应付债券	-	81,230,069.55	154,599,164.64	2,675,082,477.38	16,122,180,559.02	-	-	19,033,092,270.59
其他负债（金融负债）	240,594,933.54	6,797,490,918.60	4,375,632,343.05	1,195,275,588.34	2,300,354,617.50	-	-	14,909,348,401.03
合计	20,118,108,326.23	15,531,790,045.41	7,608,184,105.20	7,124,795,972.59	18,422,535,176.52	-	-	68,805,413,625.95

金融负债	2015 年 12 月 31 日							
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	合计
短期借款	-	12,297,171.99	80,087,185.85	1,778,307.89	-	-	-	94,162,665.73
应付短期融资款	-	14,882,760.27	2,720,375,890.41	1,889,920,020.55	-	-	-	4,625,178,671.23
拆入资金	-	101,386,986.30	251,855,479.45	-	-	-	-	353,242,465.75
衍生金融负债	5,704,972.15	-	-	-	-	-	-	5,704,972.15
卖出回购金融资产款	-	5,730,231,052.30	2,014,029,465.89	61,826,027.40	1,248,781,589.04	-	-	9,054,868,134.63
代理买卖证券款	24,025,978,380.26	-	-	-	-	-	-	24,025,978,380.26
应付款项	70,405,540.42	-	-	-	-	-	-	70,405,540.42
应付债券	-	79,095,002.94	153,087,102.46	1,182,670,452.48	17,491,621,110.47	-	-	18,906,473,668.35
其他负债（金融负债）	208,849,792.31	4,150,224,411.62	1,581,320,400.35	605,562,682.63	331,057,792.43	-	-	6,877,015,079.34
合计	24,310,938,685.14	10,088,117,385.42	6,800,755,524.41	3,741,757,490.95	19,071,460,491.94	-	-	64,013,029,577.86



## (2) 信用风险管理

信用风险是指本公司客户（或交易对手）未能履行合同所规定的义务，或信用质量发生变化影响金融工具价值，从而给本公司带来损失的风险。

本公司的货币资金主要存放在国有商业银行或资产充足率符合规定的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

报告期内，公司面临的信用风险主要体现在债券投资、融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易、合同履行等方面。具体表现为：一是投资对象的违约或评级下降；二是交易对手的违约。

为避免信用风险，公司以债券发行人主体信用状况与债项增信措施的综合分析为基础，建立公司债券信用评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质，密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，研究完善交易对手池，以实现规避债券违约风险的目标。公司固定收益类自营业务主要投资对象为国债、短期融资券、中期票据、公司债及企业债。公司对信用类固定收益证券投资注重分散投资，对债券等非权益类证券持有量严格控制在公司及监管机构规定的范围内，并密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好，规避偿付风险。另外，公司在银行间市场开展债券交易时始终坚持按规定选择使用合适的结算方式，并采用 DVP 结算控制，交易对手结算违约而产生的信用风险。

在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务方面，为防范此类业务客户的信用风险，公司设置风险控制指标和预警阈值，强化内控机制，建立逐日盯市制度，对交易进行实时监控、主动预警，公司通过客户资信审核、授信审核、客户账户监控、及时提示交易规则等措施，严格控制融资融券业务的各个风险因素。针对股票质押式回购交易业务，公司设计了业务准入标准，还专门建立了严格的尽职调查、项目审核、规模与集中度控制、盯市、项目跟踪和平仓等制度，从业务开展的各阶段严格控制风险。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，代表本公司在资产负债表日最大风险敞口的金额如下：

项目	期末余额	期初余额
银行存款及其他货币资金	19,840,081,694.73	23,454,040,934.41
其中：客户资金存款	15,628,391,768.87	19,694,206,086.62
结算备付金	4,248,147,348.89	4,827,905,019.84
其中：客户备付金	3,651,028,899.21	4,174,930,818.95
融出资金	8,618,916,151.39	10,875,406,336.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	17,356,760,529.82	9,273,247,541.02

项目	期末余额	期初余额
衍生金融资产	6,996,544.22	3,620.00
买入返售金融资产	16,980,151,202.32	8,923,142,748.05
应收款项	218,050,440.76	333,743,476.04
应收利息	743,269,682.21	357,047,813.24
存出保证金	939,241,198.87	1,012,776,896.33
可供出售金融资产	4,390,451,071.23	4,812,450,390.80
其中：融出证券	11,131,902.17	173,728.58
其他	173,691,904.50	652,078,093.97
最大信用风险敞口	73,515,757,768.94	64,521,842,869.70

### (3) 市场风险管理

市场风险是指利率、汇率以及其他市场因素变动而引起金融工具的价值变化，进而对未来收益或者未来现金流量可能造成潜在损失的风险。影响本公司业务的市场风险主要包括市场价格风险、利率风险。

#### ① 市场价格风险

市场价格风险是指本公司所持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本公司该项风险主要表现为投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券等，所面临的最大的市场风险为公允价值的变动。公司根据风险敞口制定相关的投资规模限额和风险限额并分解到各投资部门，通过投资交易控制、风险价值、敏感性分析、压力测试等监控的综合使用来管理市场风险。

对于子公司的价格风险，主要采用证券价格波动对报告期内净利润及归属于母公司所有者的其他综合收益的影响进行分析。

报告期内本公司持有的以公允价值计价的项目如下：

项目	期末余额	占净资产%	期初余额	占净资产%
	公允价值		公允价值	
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,769,705,706.86	106.24	14,222,827,510.80	84.90
债券	17,356,760,529.82	84.71	9,273,247,541.02	55.35
基金	1,351,212,043.99	6.59	3,090,530,405.63	18.45
股票	1,903,926,718.10	9.29	1,429,284,465.98	8.53
理财产品	1,157,806,414.95	5.65	429,765,098.17	2.57
可供出售金融资产	12,618,931,640.82	61.59	13,474,446,385.59	80.43

项目	期末余额	占净资产%	期初余额	占净资产%
	公允价值		公允价值	
债券	4,379,319,169.06	21.37	4,812,276,662.22	28.73
基金	14,371,112.32	0.07	38,622,984.89	0.23
股票	2,055,048,195.35	10.03	2,796,317,600.40	16.69
信托计划	763,750,000.00	3.73	804,678,000.00	4.80
证券公司理财产品	330,914,760.07	1.62	807,583,548.56	4.82
其他理财产品	2,204,586,625.75	10.76	1,307,305,286.20	7.80
证券公司收益互换产品	2,870,941,778.27	14.01	2,907,662,303.32	17.36
合计	34,388,637,347.68	167.83	27,697,273,896.39	165.33

## ②利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本公司持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资与买入返售金融资产等，利率敏感性负债主要为应付短期融资券、拆入资金、代理买卖证券款、卖出回购金融资产款、应付债券等。

本公司通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法来衡量上述持有资产的利率风险。

下表列示于各资产负债表日本公司的利率风险。

A. 表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

## 2016 年年度报告

金融资产	2016 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	19,840,081,694.73	-	-	-	-	203,241.27	19,840,284,936.00
结算备付金	4,248,147,348.89	-	-	-	-	-	4,248,147,348.89
融出资金	588,677,232.46	1,286,542,118.05	6,743,696,800.88	-	-	-	8,618,916,151.39
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	24,346,445.50	174,765,591.60	1,434,692,689.36	14,599,047,491.56	1,123,908,311.80	4,412,945,177.04	21,769,705,706.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-	6,996,544.22	6,996,544.22
买入返售金融资产	5,908,984,993.31	1,744,258,956.91	7,702,277,252.10	1,624,630,000.00	-	-	16,980,151,202.32
应收款项	-	-	-	-	-	218,050,440.76	218,050,440.76
存出保证金	939,241,198.87	-	-	-	-	-	939,241,198.87
可供出售金融资产	-	10,825,000.00	466,450,000.00	3,888,236,939.06	777,557,230.00	8,620,980,394.33	13,764,049,563.39
持有至到期投资	-	-	3,071,835.62	6,537,008.19	-	-	9,608,843.81
其他资产（金融资产）	-	-	-	-	-	159,991,109.71	159,991,109.71
合计	31,549,478,913.76	3,216,391,666.56	16,350,188,577.96	20,118,451,438.81	1,901,465,541.80	13,419,166,907.33	86,555,143,046.22

(续上表)

金融负债	2016 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	7,260,355.20	-	173,704,157.30	-	-	-	180,964,512.50
应付短期融资款	-	2,100,000,000.00	1,780,000,000.00	-	-	-	3,880,000,000.00
衍生金融负债	-	-	-	-	-	368,524.97	368,524.97
卖出回购金融资产款	8,613,370,962.09	941,574,831.73	1,270,000,000.00	-	-	-	10,824,945,793.82
代理买卖证券款	19,566,547,771.23	-	-	-	-	-	19,566,547,771.23
应付款项	-	-	-	-	-	310,597,096.49	310,597,096.49
应付债券	-	-	2,000,000,000.00	15,477,883,546.91	-	-	17,477,883,546.91
其他负债（金融负债）	-	-	-	-	-	14,909,348,401.03	14,909,348,401.03
合计	28,187,179,088.52	3,041,574,831.73	5,223,704,157.30	15,477,883,546.91	-	15,220,314,022.49	67,150,655,646.95
净头寸							19,404,487,399.27

## 2016 年年度报告

金融资产	2015 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	23,454,040,934.41	-	-	-	-	138,113.95	23,454,179,048.36
结算备付金	4,827,905,019.84	-	-	-	-	-	4,827,905,019.84
融出资金	455,067,036.79	734,724,843.75	9,685,614,455.46	-	-	-	10,875,406,336.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	116,595,675.80	331,964,032.33	977,902,462.58	5,809,494,492.55	2,037,290,877.75	4,949,579,969.79	14,222,827,510.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	3,620.00	3,620.00
买入返售金融资产	633,401,519.26	1,806,189,021.52	5,650,382,207.27	833,170,000.00	-	-	8,923,142,748.05
应收款项	-	-	-	-	-	333,743,476.04	333,743,476.04
存出保证金	1,012,776,896.33	-	-	-	-	-	1,012,776,896.33
可供出售金融资产	36,228,000.00	40,203,320.00	384,315,986.78	3,888,907,305.44	1,267,300,050.00	8,720,934,225.94	14,337,888,888.16
持有至到期投资	-	-	36,169,505.99	9,634,655.80	-	-	45,804,161.79
其他资产（金融资产）	50,000,000.00	-	350,000,000.00	-	-	252,032,042.57	652,032,042.57
合计	30,586,015,082.43	2,913,081,217.60	17,084,384,618.08	10,541,206,453.79	3,304,590,927.75	14,256,431,448.29	78,685,709,747.94

(续上表)

金融负债	2015 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	11,914,059.36	80,000,000.00	1,770,450.00	-	-	-	93,684,509.36
应付短期融资款	-	2,700,000,000.00	1,867,350,000.00	-	-	-	4,567,350,000.00
拆入资金	100,000,000.00	250,000,000.00	-	-	-	-	350,000,000.00
衍生金融负债	-	-	-	-	-	5,704,972.15	5,704,972.15
卖出回购金融资产款	5,709,523,303.65	1,996,929,331.81	-	1,220,000,000.00	-	-	8,926,452,635.46
代理买卖证券款	24,025,978,380.26	-	-	-	-	-	24,025,978,380.26
应付账款	-	-	-	-	-	70,405,540.42	70,405,540.42
应付债券	-	-	500,000,000.00	15,966,882,811.73	-	-	16,466,882,811.73
其他负债（金融负债）	-	-	-	-	-	6,877,015,079.34	6,877,015,079.34
合计	29,847,415,743.27	5,026,929,331.81	2,369,120,450.00	17,186,882,811.73	-	6,953,125,591.91	61,383,473,928.72

净头寸							17,302,235,819.22
-----	--	--	--	--	--	--	-------------------

B. 市场利率的波动主要影响本公司持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动 100 个基点，对本公司各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

项 目	2016 年 12 月 31 日/2016 年度		2015 年 12 月 31 日/2015 年度	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
收益率曲线向上 平移 100 个基点	-333,255,033.40	-261,653,164.99	-267,534,781.30	-170,447,099.63
收益率曲线向下 平移 100 个基点	333,255,033.40	261,653,164.99	267,534,781.30	170,447,099.63

#### (4) 操作风险管理

操作风险是指由公司内部流程设置不完善、员工操作失误或未严格执行流程、信息系统故障或不完善，以及外部事件等导致公司损失的风险。

公司操作风险管理应包括操作风险的识别与评估、操作风险监测、操作风险控制、操作风险报告、操作风险处置等流程。风险管理部门负责公司整体操作风险的管理，对公司总体操作风险实施评估、量化，并对各部门操作风险管理的情况和制度执行情况进行监督；合规管理部门从合规管理工作角度、操作风险专业角度以及内部控制有效性相关角度，协同开展工作；各业务部门、支持部门等按照职能分工，分别执行本业务领域的操作风险管控，并不断完善的制度流程，确保其能覆盖业务操作的各个环节。

报告期内，公司定期对内部控制、合规有效性和风险管理进行评价，对各业务内部控制进行不定期检查外，专项开展了私募资产管理、投资银行、互联网金融、资产证券化、股转交易业务适当性管理、发布研究报告等业务的自查，通过自查发现操作风险隐患并及时对问题进行了整改。此外，公司启动了操作风险系统建设工作，以实现操作风险数量化和信息化，最终实现操作风险的有效控制。

### 附注 9、公允价值的披露

#### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值 计量	第二层次公允价值 计量	第三层次公允价值 计量	合计
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一)以公允价值计量且变动 计入当期损益的金融资产	5,236,762,394.88	16,532,943,311.98		21,769,705,706.86
1. 交易性金融资产	5,236,762,394.88	16,532,943,311.98		21,769,705,706.86
(1) 债务工具投资	4,038,467,601.55	13,318,292,928.27		17,356,760,529.82
(2) 权益工具投资	1,198,294,793.33	3,214,650,383.71		4,412,945,177.04
2. 指定以公允价值计量且其 变动计入当期损益的金融资 产				
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(二) 可供出售金融资产	1,753,139,699.09	10,865,791,941.73		12,618,931,640.82
(1) 债务工具投资	-	4,379,319,169.06		4,379,319,169.06
(2) 权益工具投资	1,753,139,699.09	6,486,472,772.67		8,239,612,471.76

(三) 衍生金融资产		6,996,544.22		6,996,544.22
持续以公允价值计量的资产总额	6,989,902,093.97	27,405,731,797.93		34,395,633,891.90
(四) 交易性金融负债		368,524.97		368,524.97
持续以公允价值计量的负债总额		368,524.97		368,524.97

## 2、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

适用  不适用

对于存在活跃市场的以公允价值计量且其变动计入当期损益的资产及负债、可供出售金融资产，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。

活跃市场，是指相关资产或负债的交易量和交易频率足以持续提供定价信息的市场。

## 3、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

适用  不适用

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。

权益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关证券交易所报价计算的相关权益证券回报率确定的。场外期权的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

## 4、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

适用  不适用

## 5、本期内发生的估值技术变更及变更原因

适用  不适用

## 6、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

适用  不适用

本公司管理层认为，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

## 附注 10、关联方关系及其交易

## 1、关联方关系

(1) 第一大股东持股情况如下 (单位: 人民币万股)

关联方名称	关联方关系	期末			年初		
		持股数	持股比例	表决权比例	持股数	持股比例	表决权比例
苏州国际发展集团有限公司	股东	69,337.15	23.11%	23.11%	69,337.15	25.68%	25.68%

本公司第一大股东概况

关联方名称	注册地	主营业务	与公司关系	经济性质	法定代表人	存在控制关系的期间
苏州国际发展集团有限公司	中国苏州	授权范围的国有资产经营管理, 国内商业、物资供销业(国家规定的专营、专项审批商品除外), 提供各类咨询服务。	控股股东	有限责任	黄建林	2006年起

报告期本公司的第一大股东注册资本及其变化

企业名称	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
苏州国际发展集团有限公司	100,000.00 万元	150,000.00 万元	-	250,000.00 万元

受本公司第一大股东控制的其他股东所持公司股份或权益及其变化

企业名称	期末			年初		
	金额	持股比例	表决权比例	金额	持股比例	表决权比例
苏州市营财投资集团公司	6,457.86 万股	2.15%	2.15%	6,457.86 万股	2.39%	2.39%
苏州信托有限公司	5,312.00 万股	1.77%	1.77%	5,312.00 万股	1.97%	1.97%

苏州国际发展集团有限公司及其控制的其他股东合计持有公司 27.03%股份。

(2) 本公司的子公司

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	持股比例	表决权比例	是否合并
东吴期货有限公司	上海市黄浦区西藏南路 1208 号东吴证券大厦 6 楼	商品期货经纪, 金融期货经纪, 期货投资咨询(涉及行政许可的凭许可证经营)。	50,000.00 万元	93.80%	93.80%	是
东吴创业投资有限公司	花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦	创业投资业务; 代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务; 创业投资咨询业务; 为创业企业提供创业管理服务业务; 参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。	120,000.00 万元	100.00%	100.00%	是
东吴创新资本管理有限责任公司	昆山花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦	项目投资、实业投资、股权投资, 投资管理, 投资信息咨询服务。	200,000.00 万元	100.00%	100.00%	是
东吴基金管理有限责任公司	中国(上海)自由贸易试验区源深路 279 号	基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务(涉及许可经营的凭许可证经营)。	10,000.00 万	70.00%	70.00%	是
上海新东吴优胜资产管理有限责任公司	上海市黄浦区九江路 769 号 1806-3 室	为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。	5,000.00 万元	70.00%	70.00%	是



## 2016 年年度报告

东吴创业投资（徐州）有限责任公司	徐州市泉山区建国西路 75 号锦绣嘉园 8 号楼 1-2309 室	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构	1,000.00 万元	100.00%	100.00%	是
东吴并购资本管理（上海）有限公司	上海市黄浦区西藏南路 1208 号 18 层 A 室	资产管理，股权投资管理，投资咨询，财务咨询（不得从事代理记账）	2,000.00 万元	100.00%	100.00%	是
东吴并购股权投资基金（上海）合伙（有限合伙）	上海 上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-7 室	股权投资，股权投资管理，实业投资，资产管理，投资咨询，企业管理咨询，商务信息咨询，企业形象策划，市场营销策划	31,870.00 万元	100.00%	100.00%	是
上海东吴玖盈投资管理有限公司	上海市黄浦区普安路 128 号 703 室 H8 座	投资管理及咨询，实物投资等	10,000.00 万元	100.00%	100.00%	是
昆山东吴阳澄投资管理有限公司	昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房	股权投资管理	100.00 万元	80.00%	80.00%	是
东吴证券中新（新加坡）有限公司	Robinson Road, #17-00, AIA Tower, Singapore 048542	资产管理业务及监管部门核准的其他证券业务（具体业务范围以监管部门核准为准）	1,000.00 万元（新加坡元）	75.00%	75.00%	是
昆山东吴阳澄创业投资中心（有限合伙）	昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。	10,000.00 万元	50.50%	50.50%	是
东吴证券（香港）金融控股有限公司	RM 1202A 12/F WING ON HOUSE NO. 71 DES VOEUX RD CENTRAL HONG KONG	投资	10,000.00 万元（港币）	100.00%	100.00%	是
东吴（香港）投资有限公司	SUITE 508, 5/F TOWER 1 SILVERCORD 30 CANTON RD TST KLN HONG KONG	投资	50,000.00 万元（港币）	100.00%	100.00%	是
东吴国际资本有限责任公司	开曼群岛	投资	5.00 万元（美元）	100.00%	100.00%	是
苏州东吴城市建设资产管理有限公司	苏州工业园区胜浦新路 1 号金雅苑 1 幢 108 商号二楼	投资管理、资产管理、投资咨询、市场营销策划	200.00 万元	100.00%	100.00%	是
苏州工业园区东并投资管理有限公司	苏州工业园区星阳街 5 号 东吴证券大厦 7 层 722 室	投资管理、投资咨询	100.00 万元	100.00%	100.00%	是
宁波梅山保税港区东吴丹生创业投资合伙企业（有限合伙）	北仑区梅山大道商务中心 十一号 办公楼 2203 室	创业投资及相关咨询服务	8,000.00 万元	48.00%	48.00%	是

## (3) 本公司联营企业

间接持有：

公司名称	注册地址	主营业务	注册资本	持股比例	表决权比例	是否合并
许昌市绿野农业科技有限公司	许昌市魏都民营科技园区管委会办公楼	农产品的种植及销售（不含粮油销售）	1,590.00 万元	35.00%	35.00%	否

## 2016 年年度报告

华元恒道(上海)投资管理有限公司	上海市黄浦区南苏州路381号405D03室	股权投资管理	20,500.00万元	19.51%	19.51%	否
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	苏州高新区科创路18号	网络技术服务	25,000.00万元	32.00%	32.00%	否
苏州资产管理有限公司	苏州市高新区狮山路28号 苏州高新国际商务广场 4001-1005室	投资管理、投资咨询	120,000.00万元	20.00%	20.00%	否

注：苏州资产管理有限公司为本公司投资的联营企业。许昌市绿野农业科技有限公司和华元恒道(上海)投资管理有限公司为本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资的联营企业。东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司为本公司全资子公司东吴创新资本管理有限责任公司投资的联营企业。

## (4) 其他关联企业

企业名称	与本公司关系	注册号
光大保德信基金管理有限公司	本公司独立董事担任独立董事	310000400379940
江苏隆力奇集团有限公司	本公司监事任副总裁，公司股东	320581000066369
江苏隆力奇生物科技股份有限公司	本公司监事任副总裁兼金融投资部总经理，公司股东	320000000018416
江苏省广电有线信息网络股份有限公司	本公司独立董事担任独立董事	320000000075251
昆山市创业控股有限公司	本公司监事任总裁，公司股东	320583000008825
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	本公司董事任董事长、总裁，公司股东	320594000000909
苏州工业园区经济发展有限公司	本公司董事任董事长，公司股东	320594000004244
苏州国发创业投资控股有限公司	国发集团直接持股 60%，间接持股 40%	320500000059879
苏州国发高新创业投资管理有限公司	国发创投持股比例为 50%	320512000091268
苏州国发中小企业担保投资有限公司	本公司监事任董事	320500000006459
苏州市国发物业管理有限公司	国发集团间接持股 100%	320502000127783
苏州文化博览中心有限公司	本公司董事担任董事	320594000002923
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	国发创投持股比例为 50%	320506000147812
苏州银行股份有限公司	本公司董事担任董事	320500000039152
苏州元禾控股有限公司	本公司董事担任董事、公司股东	320594000005323
重若(苏州)资产管理有限公司	东吴在线全资子公司	320512000250927
弦高(苏州)资产管理有限公司	东吴在线全资子公司	320512000250935
张家港市直属公有资产经营有限公司	公司监事担任高管	913205827115792903
苏州市投资有限公司	公司董事担任董事(该董事已于 2017 年 2 月 24 日辞任董事职务)	913205941377106448
东吴人寿保险股份有限公司	国发集团董事长任董事长	320500000080562

## 2、与关联方的交易事项

## (1) 代买卖证券款

企业名称	期末	年初
	金额	金额
苏州信托有限公司	12,676.53	1,910,792.07
苏州工业园区经济发展有限公司	-	935,553.63
苏州国发创业投资控股有限公司	-	172.20

## 2016 年年度报告

企业名称	期末	年初
	金额	金额
苏州国发高新创业投资管理有限公司	3,929.91	3,916.00
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	357.51	356.23
江苏隆力奇集团有限公司	2,301,291.64	13,066,102.92
江苏隆力奇科技股份有限公司	1,658.29	1,652.42
昆山市创业控股有限公司	-	1,851,909.06
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	-	7,742,477.67
东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司	2,320,663.57	107.71
弦高(苏州)资产管理有限公司	44,821,892.87	3,537.26
重若(苏州)资产管理有限公司	-	100,513.97
张家港市直属公有资产经营有限公司	35,082,996.67	-
苏州市投资有限公司	43,186.47	-
合计	84,588,653.46	25,617,091.14

## (2) 手续费及佣金收入

企业名称	本期	上期
	金额	金额
苏州国际发展集团有限公司	-	1,059,913.34
苏州信托有限公司	30,641.51	72,766.85
江苏隆力奇集团有限公司	68,238.18	207,176.20
昆山市创业控股有限公司	-	192,141.57
东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司	73,613.96	1,814.70
弦高(苏州)资产管理有限公司	416,377.69	1,020.78
重若(苏州)资产管理有限公司	-	206.98
张家港市直属公有资产经营有限公司	7.15	-
苏州市投资有限公司	68,606.25	-
光大保德信基金管理有限公司	223,880.39	-
合计	881,365.13	1,535,040.42

## (3) 利息支出

企业名称	本期	上期
	金额	金额
苏州国际发展集团有限公司	-	6,058.22
苏州市营财投资集团公司	-	10.81
苏州信托有限公司	15,092.51	1,477.50
苏州国发创业投资控股有限公司	-	0.61
苏州国发高新创业投资管理有限公司	13.91	13.83
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	1.28	1.25
苏州国发中小企业担保投资有限公司	-	17.42

## 2016 年年度报告

企业名称	本期	上期
	金额	金额
苏州工业园区经济发展有限公司	-	1,621.25
江苏隆力奇集团有限公司	3,895.00	32,941.18
江苏隆力奇生物科技股份有限公司	-	5.83
昆山市创业控股有限公司	-	29,750.90
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	-	13,381.42
东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司	1,467.09	391.59
弦高(苏州)资产管理有限公司	38,860.36	66.77
重若(苏州)资产管理有限公司	-	110.67
张家港市直属公有资产经营有限公司	124,183.79	-
苏州市投资有限公司	3,946.71	-
合计	187,460.65	85,849.25

## (4) 收取财务顾问费及咨询费

企业名称	本期	上期
	金额	金额
苏州信托有限公司	-	2,172,960.00
苏州元禾控股有限公司	-	450,000.00
苏州国际发展集团有限公司	7,500,000.00	-
昆山市创业控股有限公司	700,000.00	-
苏州市投资有限公司	100,000.00	-
合计	8,300,000.00	2,622,960.00

## (5) 支付房屋租赁费

企业名称	本期金额	上期金额
苏州市国发物业管理有限公司	703,062.00	693,062.00
昆山市创业控股有限公司	1,400,000.00	1,400,000.00
合计	2,103,062.00	2,093,062.00

## (6) 购买产品

企业名称	本期金额	上期金额
江苏省广电有线信息网络股份有限公司	649,876.00	649,876.00
苏州文化博览中心有限公司	-	19,024.00
合计	649,876.00	668,900.00

## (7) 购买关联方东吴人寿保险股份有限公司发行的寿险产品

项目	本期金额	上期金额
企业团体年金	3,153,650.00	30,791,780.00

## 2016 年年度报告

团体意外伤害险	483,844.00	656,200.00
合 计	3,637,494.00	31,447,980.00

## (8) 期末持有由公司作为管理人募集设立的集合资产管理计划

企业名称	项 目	数量 (份)	期末净值
苏州银行股份有限公司	东吴汇智 25 号集合资产管理计划	417,428,421.00	418,173,967.03
合 计		417,428,421.00	418,173,967.03

## (9) 期末持有由公司作为管理人募集设立的定向资产管理计划

企业名称	项 目	期末管理规模	本期管理费金额
苏州信托有限公司	东吴-江苏-涌金 75 号定向资产管理计划	-	58,125.00
苏州信托有限公司	东吴-江苏-涌金 26 号定向资产管理计划	-	73,749.38
苏州信托有限公司	东吴-浙商-涌金 97 号定向资产管理计划	1,200,000,000.00	144,000.00
苏州信托有限公司	东吴-招行-汇赢 40 号定向资产管理计划	-	235,222.22
苏州银行股份有限公司	东吴-光大-苏银 1 号定向资产管理计划	1,140,000,000.00	1,366,492.71
苏州银行股份有限公司	东吴-光大-苏银 2 号定向资产管理计划	5,063,325,000.00	3,885,885.15
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	东吴-宁波-东惠 68 号定向资产管理计划	300,000,000.00	18,000.00
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	东吴-宁波-东惠 28 号定向资产管理计划	100,000,000.00	19,375.00
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	东吴-宁波-东惠 29 号定向资产管理计划	-	33,972.60
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	东吴-宁波-东惠 30 号定向资产管理计划	300,000,000.00	41,424.66
东吴在线(苏州)金融科技服务有限公司	东吴-宁波-汇赢 85 号定向资产管理计划	60,000,000.00	50,000.00
重若(苏州)资产管理有限公司	东吴-渤海-汇赢 97 号定向资产管理计划	52,531,128.00	127,796.02
合 计		8,215,856,128.00	6,054,042.74

## (10) 期末持有由关联方作为管理人募集设立的信托计划

企业名称	项 目	数量 (份)	期末净值
苏州信托有限公司	恒信 B1507 集合资金信托计划	20,000,000.00	20,000,000.00
苏州信托有限公司	恒信 J1505 信托计划	1,000,000.00	1,000,000.00
合 计		21,000,000.00	21,000,000.00

## (11) 现券买卖

企业名称	项目	数量 (份)	本期金额
光大保德信基金管理有限公司	12 济城建债	100,000.00	5,297,980.00
合 计		100,000.00	5,297,980.00

## (12) 固定收益凭证

企业名称	项目	本期金额	上期金额
苏州银行股份有限公司	固定收益凭证融通[201502]号	-	500,000,000.00
合计		-	500,000,000.00

## (13) 同业资金拆借

企业名称	本期金额	上期金额
苏州银行股份有限公司	-	200,000,000.00
合计	-	200,000,000.00

## (14) 支付利息

企业名称	本期金额	上期金额
苏州银行股份有限公司	-	136,666,67
合计	-	136,666,67

## (15) 债券质押正回购

企业名称	项目	本期金额
光大保德信基金管理有限公司	光大保德信现金宝基金	100,755,426.40
光大保德信基金管理有限公司	光大保德信耀钱包货币基金	22,012,362.19
光大保德信基金管理有限公司	光大保德信货币基金	30,000,000.00
合计		152,767,788.59

## (16) 银行理财

企业名称	项目	本期金额
苏州银行股份有限公司	“金石榴 稳盈”公司开放式1号人民币理财	10,000,000.00
合计		10,000,000.00

## (17) 承销费

企业名称	项目	本期金额
张家港市直属公有资产经营有限公司	债券承销	11,250,000.00
合计		11,250,000.00

## (18) 股票质押回购交易

企业名称	项目	本期金额
苏州市投资有限公司	斯莱克股票质押	48,000,000.00

合 计		48,000,000.00
-----	--	---------------

## (19) 高级管理人员薪酬

2016 年度		2015 年度	
人数	金额	人数	金额
8	6,932,600.00	7	17,280,000.00

根据中国证监会 2012 年下发的《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》（第 88 号令）及公司章程，公司高级管理人员包括总裁、副总裁、财务负责人、董事会秘书、合规总监、首席风险官等。

本公司 2016 年度高级管理人员任职期间薪酬实际发放人民币 693.26 万元。

(20) 本公司与关联方的交易主要参考市场价格确定。

**附注 11、或有事项****1、截至 2016 年 12 月 31 日，本公司控股子公司东吴期货有限公司的未决诉讼事项**

东吴期货有限公司大连客户徐健军与公司合同纠纷一案，由大连仲裁委员会受理，客户 2010 年 3 月申请仲裁要求返还 100 万元保证金，另索赔 30 万元，东吴期货有限公司返还了 33.35 万元保证金。大连仲裁委员会于 2012 年 2 月 17 日开庭审理了本案，未做判决，东吴期货有限公司也未收到大连仲裁委有关下一步审理进程的信息。原告之前的一个重要证据在 2013 年初，被新证据证明无效，该案基本失去了存在的基石，正常情况下该案导致东吴期货有限公司败诉或面临重大损失的可能性不大。

东吴期货有限公司吴江客户王炎锋与公司合同纠纷一案，客户 2015 年 7 月向苏州中级人民法院起诉要求公司赔偿其 2012 年 7 月至 2012 年 11 月的损失 196 万余元。法院 2016 年 7 月作出的驳回客户全部诉讼请求的判决已生效。

**2、截至 2016 年 12 月 31 日，本公司控股子公司东吴基金管理有限公司的未决诉讼事项**

2016 年 6 月 24 日，东吴基金管理有限公司收到上海市浦东新区人民法院送达的案号为 [（2016）沪 0115 民初 41948 号] 的传票、应诉通知书等材料。该民事诉讼原告为上海林孚投资管理合伙企业（普通合伙），被告为东吴基金管理有限公司，案由为证券投资咨询纠纷。目前公司已聘请诉讼代理律师，按照相关程序积极应诉中。

**3、股票质押回购的担保物司法冻结**

2014 年 9 月 17 日，本公司与客户张跃飞签订股票质押式回购业务协议（以下简称“协议”），张跃飞质押给公司 1,020.00 万股（大写：壹仟零贰拾万股）无限售流通股积成电子（002339），借款 5,000.00 万元人民币（大写：伍仟万元整），期限 12 个月，利率：8.2%/年（截止 2017 年 3 月 31 日质押股份市值 19,043.40 万元）。2015 年 3 月 3 日，积成电子股份有限公司发布公告，声称股东张跃飞先生因涉嫌非法吸收公众存款罪被东阳市人民检察院批准逮捕。公司根据协议约定向张跃飞发送还款通知书要求其提前购回股票质押交易。2015 年 9 月 17 日，由东阳市人民政府协调并支付张跃飞股票质押利息 3,097,777.78 元，并根据其申请将张跃飞股票质押交易延期至 2015 年 12 月 16 日到期。到期日客户未正常购回该笔交易，该笔交易处于已逾期状态，

2016年4月22日，经苏州市中级人民法院立案受理，公司对张跃飞提起诉讼，案号为（2016）苏05民初269号。公司主要诉讼请求为：①要求张跃飞支付购回款项54,156,944.44元并承担违约金；②要求张跃飞承担公司为实现质权所产生的所有费用以及诉讼费用。截至2016年12月31日，此案件尚未开庭审理。

## 附注 12、承诺事项

√适用 □不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

存在于2016年12月31日各项承诺事项如下：

### 1、经营租赁承诺事项

（1）、根据已签订的不可撤销的经营性租赁合同，本公司未来最低应支付租金汇总如下：

项 目	本期发生额
1 年以内	25,145,837.30
1-2 年	27,827,543.52
2-3 年	23,834,677.43
3 年以上	34,754,005.68
合 计	111,562,063.93

（2）、本公司下属子公司——东吴期货有限公司就不可撤销之营业场所及办公楼租赁协议未来需缴付的最低租金为4,744,530.00元。

（3）、本公司下属子公司——东吴基金管理有限公司就不可撤销之营业场所及办公楼租赁协议未来需缴付的最低租金为25,888,352.00元。

### 2、对外资产质押承诺

项 目	期末余额	质押到期日
卖出回购证券协议	10,824,945,793.82	-
质押品价值	12,496,373,797.46	-
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中的债券	6,361,659,639.34	2017年01月03日至2017年03月27日
可供出售金融资产中的债券	2,298,556,377.90	2017年01月03日至2017年03月27日
买入返售金融资产中的担保物债券	2,037,402,799.50	2017年01月03日至2017年03月27日
买入返售金融资产收益权	701,100,000.00	2017年04月27日至2017年08月22日
融资融券债权收益权	1,090,683,452.08	2017年01月21日至2017年04月27日
持有至到期投资中的债券	6,971,528.64	2017年01月03日

## 附注 13、资产负债表日后事项

### 1、利润分配

2017年4月6日经公司第三届董事会第九次会议决议，分别按照2016年度审计后的净利润为基准，按10%提取法定公积金、一般风险准备金、交易风险准备后，公司拟向全体股东按每10股派送1.50元红利（含税）。上述议案尚待公司股东大会审议。



## 2、获准新设营业部情况

2016年5月12日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立14家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]114号),公司获准在江苏省苏州市设立7家证券营业部,在江苏省南通市、常州市、镇江市各设立1家证券营业部,在浙江省桐乡市、海宁市各设立1家证券营业部,在辽宁省沈阳市、云南省大理市各设立1家证券营业部。截至报告日,上述2家营业部尚在筹建中。

2016年7月27日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立6家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]251号),公司获准在上海市、江苏省无锡市、广东省东莞市虎门镇、湖北省武汉市、浙江省宁波市、义乌市各设立一家证券营业部。在2016年12月31日前,已有5家营业部已设立完成并开业。截至报告日,另1家营业部也已设立完成并开业。

2016年9月19日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]259号),公司获准在天津市、江苏省丹阳市、昆山市各设立一家证券营业部。截至报告日,上述3家营业部尚在筹建中。

2016年12月21日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]270号),公司获准在贵州省铜仁市、浙江省绍兴市、江苏省江阴市各设立一家证券营业部。截至报告日,上述3家营业部尚在筹建中。

## 3、发行公司债券情况

2016年7月16日,公司第三届董事会第二次(临时)会议审议通过了《关于公司发行2016年公司债券的议案》,同意公司发行总规模不超过人民币25亿元(含25亿元)的公司债券,可一期或分期发行,期限为不超过5年(含5年),可以为单一期限品种,也可以为多种期限的混合品种,用于补充公司营运资金。同日,董事会审议通过了《关于公司发行短期公司债券的议案》,发行规模实行余额管理,待偿还短期公司债券余额不超过净资本的60%;公司根据净资产变化情况自主控制发行总额度;根据公司实际需要,可多次滚动发行。2016年7月28日,公司2016年第一次临时股东大会审议通过了上述事项。

2017年2月14日,中国证监会以《关于核准东吴证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2017]215号)文件,核准公司向合格投资者公开发行面值总额不超过25亿元的公司债券。本次债券于2017年3月10日进行簿记建档,债券发行工作于2017年3月14日结束,实际发行规模为人民币25亿元,最终票面利率为4.70%。

## 附注14、其他重要事项

### 1、分部信息

√适用 □不适用

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,在经营分部的基础上本公司确定了经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务、公司总部及其他等6个报告分部。分部信息相关的会计政策参见附注3:3.32。

本公司各个报告分部提供的主要服务分别如下:

- 
- 经纪及财富管理业务分部从事于代理客户(包括通过互联网)买卖股票、基金、债券、期货等,同时也提供专业化研究服务,协助投资者作出投资决策。
  - 投资银行业务分部向机构客户提供企业金融服务,包含股票承销与保荐、债券承销、并购重组其他财务顾问、金融创新服务。
  - 投资与交易业务分部以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。
  - 资管及基金管理业务分部提供传统资产管理业务、基金管理业务,根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。
  - 信用交易业务分部包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务。
  - 公司总部及其他分部系总部运营及除上述主营业务外的其他业务。

## 2016 年度报告分部的财务信息

项 目	经纪及财富管理业务	投资银行业务	投资与交易业务	资管及基金管理业务	信用交易业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
一、营业收入	1,645,292,106.25	896,114,520.17	1,042,754,119.66	441,782,162.71	529,342,353.98	920,185,322.35	-830,244,591.30	4,645,225,993.82
其中：手续费及佣金净收入	1,301,445,649.99	896,960,983.55	197,274,043.20	485,839,423.76	-218,397.91	61,579,904.52	-140,944,671.35	2,801,936,935.76
投资收益	-	-	1,392,939,972.89	-	-	195,154,629.34	142,198,372.71	1,730,292,974.94
其他收入（含公允价值变动）	343,846,456.26	-846,463.38	-547,459,896.43	-44,057,261.05	529,560,751.89	663,450,788.49	-831,498,292.66	112,996,083.12
二、营业支出	729,772,377.55	448,737,684.12	884,600,294.62	309,514,686.46	48,781,645.47	312,403,115.78	-26,249,694.30	2,707,560,109.70
三、营业利润（亏损）	915,519,728.70	447,376,836.05	153,960,675.00	132,267,476.25	484,753,858.55	607,782,206.57	-803,994,897.00	1,937,665,884.12
四、利润总额	920,890,120.78	450,131,741.25	161,961,058.92	140,491,644.47	525,559,234.28	605,088,874.28	-804,890,397.00	1,999,232,276.98
五、资产总额	21,541,514,131.84	544,393,994.82	29,469,494,100.71	2,180,353,418.09	15,570,207,007.92	27,048,559,130.16	-6,877,820,054.80	89,476,701,728.74
递延所得税资产								418,351,931.49
六、负债总额	19,853,660,446.83	162,044,275.10	31,706,141,093.29	171,925,654.99	47,823,752.77	2,458,407,414.06	14,587,480,127.40	68,987,482,764.44
递延所得税负债								22,006,180.74
七、补充信息								
1. 折旧与摊销费用	53,154,619.92	2,256,143.75	2,909,628.32	9,732,564.09	1,257,892.59	51,626,214.32	-	120,937,062.99
2. 资本性支出	31,116,023.68	2,325,809.25	5,417,245.68	12,206,263.96	408,349.58	62,510,863.52	-	113,984,555.67
3. 资产减值损失	-	-	346,570,949.77	-	4,193,150.04	-	-	350,764,099.81

## 2015 年度报告分部的财务信息

项 目	经纪及财富管理业务	投资银行业务	投资与交易业务	资管及基金管理业务	信用交易业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
一、营业收入	3,025,988,863.82	806,570,370.75	1,778,531,955.89	430,205,335.90	695,660,177.68	1,062,886,593.13	-969,681,371.85	6,830,161,925.32
其中：手续费及佣金净收入	2,639,036,117.08	757,556,414.50	10,712,788.29	484,451,725.87	-791,002.20	50,186,034.56	-119,542,919.64	3,821,609,158.46
投资收益	-	-	2,160,257,478.35	-	-	484,095,494.13	-260,376,220.46	2,383,976,752.02
其他收入（含公允价值变动）	386,952,746.74	49,013,956.25	-392,438,310.75	-54,246,389.97	696,451,179.88	528,605,064.44	-589,762,231.75	624,576,014.84
二、营业支出	1,125,216,918.35	468,563,237.90	339,190,512.23	305,870,536.21	169,993,621.92	710,382,329.99	-13,195,842.52	3,106,021,314.08
三、营业利润（亏损）	1,900,771,945.47	338,007,132.85	1,439,341,443.66	124,334,799.69	525,666,555.76	352,504,263.14	-956,485,529.33	3,724,140,611.24
四、利润总额	1,900,154,273.44	338,184,545.75	1,350,694,874.96	149,889,695.36	525,491,340.76	355,873,093.33	-963,021,408.78	3,657,266,414.82
五、资产总额	26,978,882,915.78	507,700,790.97	30,211,382,016.39	683,069,638.90	14,444,620,893.78	13,267,909,761.58	-5,504,429,483.84	80,589,136,533.56
递延所得税资产								167,302,236.93
六、负债总额	24,404,763,121.28	174,386,250.41	30,717,852,056.36	156,799,533.44	37,332,991.64	1,693,877,453.37	6,651,756,261.05	63,836,767,667.55
递延所得税负债								9,617,062.63
七、补充信息								
1. 折旧与摊销费用	51,509,594.36	1,897,727.59	1,160,675.00	10,104,727.43	1,431,787.40	51,534,397.49		117,638,909.27
2. 资本性支出	78,798,276.55	587,013.00	2,731,083.00	9,639,056.75	766,470.00	14,671,933.64		107,193,832.94
3. 资产减值损失	-	-	-	-	22,797,025.87	-		22,797,025.87

## 2、以公允价值计量的资产和负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
<b>金融资产</b>					
1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	14,222,827,510.80	-505,113,059.71	-	-	21,769,705,706.86
2、衍生金融资产	3,620.00	7,517,519.46			6,996,544.22
3、可供出售金融资产	13,474,446,385.59	-	-76,155,783.65	322,386,035.33	12,618,931,640.82
金融资产小计	27,697,277,516.39	-497,595,540.25	-76,155,783.65	322,386,035.33	34,395,633,891.90
其他					
上述合计	27,697,277,516.39	-497,595,540.25	-76,155,783.65	322,386,035.33	34,395,633,891.90
金融负债	5,704,972.15	2,413,802.15			368,524.97

## 3、融资融券业务

公司将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。公司将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，继续确认该金融资产，计入融出证券。截至2016年12月31日，本公司融出资金余额为8,636,188,528.45元，融出证券余额为11,153,895.54元。客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况如下：

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	773,224,693.59	1,071,954,556.55
股票	22,238,223,963.86	27,969,876,360.07
债券	322,473.55	-
基金	16,517,877.80	32,642,627.13
合计	23,028,289,008.80	29,074,473,543.75

## 4、转融通融入业务

本年度公司无转融通融入证券情况。

## 5、公益性投入

本年度公司在公益广告、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等公益性方面的投入金额共计131.80万元，其中教育资助方面投入31.50万元，慈善捐赠方面投入100.30万元。

## 6、新设证券营业部

2016年2月3日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复》（苏证监机构字[2016]35号），公司获准在云南省昆明市、浙江省台州市、北京市各设立一家证券营业部。截至2016年12月31日，上述3家营业部已设立完成并开业。

2016年5月12日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立14家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]114号),公司获准在江苏省苏州市设立7家证券营业部,在江苏省南通市、常州市、镇江市各设立1家证券营业部,在浙江省桐乡市、海宁市各设立1家证券营业部,在辽宁省沈阳市、云南省大理市各设立1家证券营业部。截至2016年12月31日,上述12家营业部已设立完成并开业。

2016年7月27日,根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立6家分支机构的批复》(苏证监机构字[2016]251号),公司获准在上海市、江苏省无锡市、广东省东莞市虎门镇、湖北省武汉市、浙江省宁波市、义乌市各设立一家证券营业部。截至2016年12月31日,上述5家营业部已设立完成并开业。

## 7、所有权或使用权受到限制的资产

项 目	期末余额	期初余额
货币资金	110,341,349.15	100,693,067.86
融出资金	1,090,683,452.08	1,631,062,550.82
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6,361,659,639.34	4,614,329,120.80
买入返售金融资产	2,738,502,799.50	321,449,700.00
持有至到期投资	6,537,008.19	-
可供出售金融资产	2,666,972,842.97	4,124,215,066.07

## 8、对子公司东吴创新资本的增资

根据东吴证券股份有限公司2017年2月27日的第三届董事会第七次(临时)会议决议,本公司对东吴创新资本增资20亿元人民币,增资完成后东吴创新资本注册资本增加至40亿元人民币。

## 附注 15、母公司财务报表主要项目注释

### 15.01 应收款项

#### (1) 按明细列示

项 目	期末余额	期初余额
应收证券清算款	56,087,350.00	45,643,623.44
应收资产管理费	16,481,154.58	13,804,565.07
其他	56,495,247.76	210,781,752.78
减: 减值准备	12,462,306.59	21,781,752.78
应收款项账面价值	116,601,445.75	248,448,188.51

#### (2) 按账龄分析

项 目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
1年以内	78,916,356.46	61.15	2,462,306.59	3.12
1-2年	50,012,443.85	38.75	10,000,000.00	20.00
2-3年	134,952.03	0.10	-	-

## 2016 年年度报告

项 目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
3 年以上	-	-	-	-
合 计	129,063,752.34	100.00	12,462,306.59	9.66

(续上表)

项 目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
1 年以内	269,398,283.99	99.69	21,781,752.78	8.09
1-2 年	831,657.30	0.31	-	-
2-3 年	-	-	-	-
3 年以上	-	-	-	-
合 计	270,229,941.29	100.00	21,781,752.78	8.06

(3) 按评估方式列示

种 类	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
单项计提减值准备	-	-	-	-
组合计提减值准备	129,063,752.34	100.00	12,462,306.59	9.66
合 计	129,063,752.34	100.00	12,462,306.59	9.66

(续上表)

项 目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)
单项计提减值准备	-	-	-	-
组合计提减值准备	270,229,941.29	100.00	21,781,752.78	8.06
合 计	270,229,941.29	100.00	21,781,752.78	8.06

(4) 应收款项余额中前五单位名称/性质情况

单位名称	金额	账龄	占应收款项 总额比例 (%)	款项性质
证券清算款	56,087,350.00	1 年以内	43.46	证券清算款
张跃飞	50,000,000.00	1-2 年	38.74	股票质押回购业务
刁俐佳	1,932,761.68	1 年以内	1.50	两融业务款
东吴证券现金增利集合资产管理计划	2,004,360.50	1 年以内	1.55	资产管理业务产品管理费
东吴汇天盈 1 号集合资产管理计划	1,513,095.87	1 年以内	1.17	资产管理业务产品管理费
合 计	111,537,568.05		86.42	

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

## 15.02 长期股权投资

## (1) 按类别列示

项目	期末余额	期初余额
子公司	3,387,195,337.79	2,863,196,035.71
联营企业	239,936,556.09	-
合营企业	-	-
其他股权投资	-	-
小计	3,627,131,893.88	2,863,196,035.71
减：减值准备	-	-
合 计	3,627,131,893.88	2,863,196,035.71



## (2) 子公司投资情况

被投资单位	核算方法	投资成本	期初余额	增减变动	期末余额	在被投资单位持股比例 (%)	在被投资单位表决权比例 (%)	在被投资单位持股比例与表决权比例不一致的说明	减值准备	本期计提减值准备	本期现金红利
东吴期货有限公司	成本法	555,481,736.00	525,450,000.00	30,031,736.00	555,481,736.00	93.80	93.80	-	-	-	32,645,543.52
东吴创业投资有限公司	成本法	879,200,000.00	650,000,000.00	229,200,000.00	879,200,000.00	100.00	100.00	-	-	-	107,000,000.00
东吴创新资本管理有限公司	成本法	1,600,000,000.00	1,421,328,000.00	178,672,000.00	1,600,000,000.00	100.00	100.00	-	-	-	43,000,000.00
东吴基金管理有限公司	成本法	232,127,285.71	232,127,285.71	-	232,127,285.71	70.00	70.00	-	-	-	-
东吴证券(香港)金融控股有限公司	成本法	86,095,566.08	-	86,095,566.08	86,095,566.08	100.00	100.00	-	-	-	-
东吴证券中新(新加坡)有限公司	成本法	34,290,750.00	34,290,750.00	-	34,290,750.00	75.00	75.00	-	-	-	-
合计		3,387,195,337.79	2,863,196,035.71	523,999,302.08	3,387,195,337.79	-	-	-	-	-	182,645,543.52

报告期内被投资单位经营正常，近期内不会出现可收回金额低于账面价值的情况，无需计提长期投资减值准备。

## (3) 联营企业投资情况

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额	
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备			其他
一、联营企业：											
苏州资产管理有限公司	-	240,000,000.00	-	-63,443.91	-	-	-	-	-	239,936,556.09	-
合计	-	240,000,000.00	-	-63,443.91	-	-	-	-	-	239,936,556.09	-

报告期内被投资单位经营正常，近期内不会出现可收回金额低于账面价值的情况，无需计提长期投资减值准备。

## 15.03 其他资产

按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
其他应收款	54,710,821.24	64,591,512.56
待摊费用	11,926,661.68	7,543,600.37
长期待摊费用	25,811,051.19	25,463,922.58
其他长期资产	6,046,608.00	25,226,608.00
其他	308,684.42	-
合 计	98,803,826.53	122,825,643.51

## (1) 其他应收款

## ①按明细列示

项 目	期末余额	期初余额
其他应收款余额	54,710,821.24	64,591,512.56
减：坏账准备	-	-
其他应收款净值	54,710,821.24	64,591,512.56

## ②其他应收款按种类分析

种 类	期末余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)	
单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款	36,041,500.00	65.88	-	-	36,041,500.00
按组合计提坏账准备的其他应收款					
组合一	17,303,889.97	31.62	-	-	17,303,889.97
组合小计	17,303,889.97	31.62	-	-	17,303,889.97
单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款	1,365,431.27	2.50	-	-	1,365,431.27
合 计	54,710,821.24	100.00	-	-	54,710,821.24

(续上表)

种 类	期初余额				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金 额	比例 (%)	金 额	比例 (%)	
单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款	36,041,500.00	55.80	-	-	36,041,500.00
按组合计提坏账准备的其他应收款					
组合一	27,782,898.30	43.01	-	-	27,782,898.30
组合小计	27,782,898.30	43.01	-	-	27,782,898.30
单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款	767,114.26	1.19	-	-	767,114.26
合 计	64,591,512.56	100.00	-	-	64,591,512.56

## ③组合中，按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款：

项 目	期末余额		
	其他应收款	坏账准备	计提比例
1 年以内	14,931,896.88	-	-
1-2 年	2,094,603.79	-	-
2-3 年	277,389.30	-	-
3 年以上	-	-	-
合 计	17,303,889.97	-	-

(续上表)

项 目	期初余额		
	其他应收款	坏账准备	计提比例
1 年以内	25,478,168.24	-	-
1-2 年	1,021,022.97	-	-
2-3 年	1,283,707.09	-	-
3 年以上	-	-	-
合 计	27,782,898.30	-	-

## ④期末其他应收款中主要项目

单位名称	金额	账龄	占其他应收款 总额比例 (%)	款项性质
张家港市中昊房地产有限公司	36,041,500.00	3 年以上	65.88	预付购房款
上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司	3,111,877.77	1 年以内	5.69	房租押金
北京鑫景通达置业有限公司	959,293.20	2 年以内	1.75	房屋租赁保证金
陈宁	816,280.00	1 年以内	1.49	房屋租赁保证金
张家口市华盛建设工程招标代理事务所有限公司	800,000.00	1 年以内	1.46	投标保证金
合 计	41,728,950.97		76.27	

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

## (2) 待摊费用

项目	期末余额	期初余额
房租	10,758,000.43	7,266,549.55
电费	991,979.18	-
其他	176,682.07	277,050.82
合 计	11,926,661.68	7,543,600.37

## (3) 长期待摊费用

## 2016 年度增减变动情况

项目	取得方式	原始金额	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
					本期摊销	其他减少	
装修费	购入	44,041,743.29	20,508,017.31	9,367,699.29	8,831,943.09	-	21,043,773.51
网络工程	购入	2,632,229.18	1,756,011.23	342,120.61	845,996.73	-	1,252,135.11
办公家具	购入	6,893,499.15	2,295,299.93	1,331,323.83	911,476.56	-	2,715,147.20
水电增容	购入	228,400.15	125,870.76	54,772.83	112,374.60	-	68,268.99
消防工程	购入	2,096,553.03	778,723.35	298,425.85	345,422.82	-	731,726.38
合计		55,892,424.80	25,463,922.58	11,394,342.41	11,047,213.80	-	25,811,051.19

## (4) 其他长期资产

项目	期末余额	期初余额
苏州名城信息港发展有限公司	4,546,608.00	4,546,608.00
苏州奥杰汽车技术股份有限公司	-	850,000.00
湘村高科农业股份有限公司	-	9,630,000.00
深圳市联赢激光股份有限公司	-	5,000,000.00
成都好房通科技有限公司	-	3,000,000.00
安徽白兔湖动力股份有限公司	-	2,200,000.00
武汉爱立方儿童教育传媒股份有限公司	1,500,000.00	-
合计	6,046,608.00	25,226,608.00

上述款项为本公司支付的新三板做市业务增资预付款。

## 15.04 手续费及佣金净收入

## (1) 项目明细

项目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入		
1. 经纪业务收入	1,550,500,061.85	3,358,460,117.73
其中：证券经纪业务收入	1,550,500,061.85	3,358,460,117.73
其中：代理买卖证券业务	1,448,694,751.19	3,293,318,761.58
交易单元席位租赁	85,587,849.47	53,878,036.36
代销金融产品业务	16,217,461.19	11,263,319.79
期货经纪业务收入	-	-
2. 投资银行业务收入	911,506,287.45	765,676,414.50
其中：证券承销业务	557,957,273.96	460,931,235.93
保荐服务业务	43,028,301.60	35,375,000.00
财务顾问业务	310,520,711.89	269,370,178.57

## 2016 年年度报告

项目	本期发生额	上期发生额
3. 投资咨询服务收入	61,107,075.02	50,256,449.13
4. 资产管理业务收入	263,842,911.97	258,772,857.06
5. 其他	2,822,393.93	1,888,505.79
手续费及佣金收入小计	2,789,778,730.22	4,435,054,344.21
手续费及佣金支出	-	-
1. 经纪业务支出	404,574,623.26	780,859,201.04
其中：证券经纪业务	404,574,623.26	780,859,201.04
其中：代理买卖证券业务	404,574,623.26	780,859,201.04
交易单元席位租赁	-	-
代销金融产品业务	-	-
期货经纪业务支出	-	-
2. 投资银行业务支出	14,545,303.90	8,120,000.00
其中：证券承销业务	3,623,864.15	4,250,000.00
保荐服务业务	-	-
财务顾问业务	10,921,439.75	3,870,000.00
3. 投资咨询服务支出	96,599.15	-
4. 资产管理业务支出	6,435,543.02	4,347,682.86
5. 其他	3,415,798.01	14,708,596.01
手续费及佣金支出小计	429,067,867.34	808,035,479.91
手续费及佣金净收入	2,360,710,862.88	3,627,018,864.30
其中：财务顾问业务净收入	299,599,272.14	265,500,178.57
——并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司	39,950,000.00	25,610,000.00
——并购重组财务顾问业务净收入-其他	-	-
——其他财务顾问业务净收入	259,649,272.14	239,890,178.57

## 15.05 投资收益

## (1) 投资收益明细情况

项目	本期发生额	上期发生额
1. 权益法确认的收益	-63,443.91	-
2. 成本法确认的收益	182,645,543.52	184,634,000.00
3. 金融工具持有期间取得的分红和利息	782,617,476.48	354,653,116.70
——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	325,190,639.21	24,947,112.90
——持有至到期投资	-	-
——可供出售金融资产	457,426,837.27	329,706,003.80
4. 处置收益	409,273,284.97	1,575,114,489.47
——长期股权投资	-	-
——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	59,621,445.93	641,904,093.19

## 2016 年年度报告

项目	本期发生额	上期发生额
——衍生金融工具	-2,098,314.06	-36,046,446.84
——持有至到期投资	-	-
——可供出售金融资产	351,750,153.10	969,256,843.12
5. 其他	-	-
合计	1,374,472,861.06	2,114,401,606.17

## (2) 按联营企业和合营企业的投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额
苏州资产管理有限公司	-63,443.91	-
合计	-63,443.91	-

## (3) 按成本法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额
东吴创业投资有限公司	107,000,000.00	33,000,000.00
东吴创新资本管理有限公司	43,000,000.00	122,000,000.00
东吴期货有限公司	32,645,543.52	29,634,000.00
合计	182,645,543.52	184,634,000.00

(4) 公司投资收益汇回无重大限制情况。

## 15.06 公允价值变动收益

产生公允价值变动收益的来源	本期发生额	上期发生额
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-409,809,011.08	235,154,432.48
衍生金融工具	11,828,644.37	16,160,659.85
合计	-397,980,366.71	251,315,092.33

## 15.07 现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

项目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	1,486,649,685.65	2,658,682,072.90
加：资产减值准备	326,814,099.81	22,797,025.87
固定资产折旧	74,107,425.14	70,665,528.40
无形资产摊销	21,857,111.99	17,779,875.46
长期待摊费用摊销	11,047,213.80	16,028,283.92
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减：收益)	323,751.76	1,547,608.79
固定资产报废损失	-	-
公允价值变动损失	-	-
利息支出	1,029,858,409.75	764,788,687.24
投资损失(减：收益)	-182,582,099.61	-184,634,000.00

## 2016 年年度报告

项目	本期发生额	上期发生额
递延所得税资产减少(减:增加)	-198,501,287.76	-113,581,467.65
递延所得税负债增加(减:减少)	-	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产减少	-	-
经营性应收项目的减少(减:增加)	-3,494,003,664.92	-7,094,707,129.74
经营性应付项目的增加(减:减少)	-5,641,387,604.35	2,949,054,570.42
其他	-	-
经营活动产生的现金流量净额	-6,565,816,958.74	-891,578,944.39
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	21,005,436,186.56	26,573,368,824.16
减: 现金的期初余额	26,573,368,824.16	14,418,820,762.62
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	-5,567,932,637.60	12,154,548,061.54

## (2) 现金及现金等价物的构成

项目	本期发生额	上期发生额
一、现金	21,005,436,186.56	26,573,368,824.16
其中: 库存现金	85,555.67	69,503.33
可随时用于支付的银行存款	16,841,563,396.73	21,777,808,333.18
可随时用于支付的结算备付金	4,154,972,704.87	4,745,490,997.69
其他货币资金	8,814,529.29	49,999,989.96
二、现金等价物	-	-
三、期末现金及现金等价物余额	21,005,436,186.56	26,573,368,824.16

## 附注 16、补充资料

## 1、当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-379,668.78	
越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	25,933,136.96	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-5,077,130.89	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	-5,119,084.32	
少数股东权益影响额	-1,191,993.72	
合计	14,165,259.25	

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

本公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产、贷款和应收款项期间取得的投资收益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具和可供出售金融资产取得的投资收益不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目的原因：本公司作为证券经营机构，上述业务均属于本公司的正常经营业务。

## 2、净资产收益率及每股收益

√适用 □不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	7.58	0.50	0.50
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	7.50	0.50	0.50

(续上表)

2015 年度	净资产收益率 (%)	每股收益 (人民币元)	
	加权平均	基本每股收益	稀释每股收益
归属于母公司所有者的净利润	17.69	1.00	1.00
扣除非经常性损益后归属于母公司所有者的净利润	17.62	1.00	1.00

### (1) 加权平均净资产收益率计算过程

项目名称	序号	2016 年度	2015 年度
归属于公司普通股股东的净利润	P0 (NP)	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88
扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益		14,165,259.25	10,300,931.11
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	P0	1,484,123,247.13	2,698,193,970.77
归属于公司普通股股东的期初净资产	E0	16,539,917,099.39	14,078,857,196.50
报告期发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	Ei	3,393,002,000.00	-
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	Mi	11.00	-
报告期月份数	M0	12.00	12.00
报告期回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	Ej	900,000,000.00	337,500,000.00
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数	Mj	6.00	6.00
单方增资东吴期货引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动	Ek1	-5,675,327.46	-
发生单方增资东吴期货增减变动次月起至报告期期末的累计月数	Mk1	11.00	-
东吴在线权益法核算调整增加的资本公积		112,000,000.00	-



## 2016 年年度报告

东吴在线权益法核算调整增加资本公积次月起至报告期期末的累计月数		4.00	-
因其他交易或事项引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动	Ek2	-410,362,732.58	90,065,001.01
发生其他净资产增减变动次月起至报告期期末的累计月数	Mk2	6.00	6.00
扣除非经常性损益前加权平均净资产收益率(%)※1		7.58%	17.69%
扣除非经常性损益后加权平均净资产收益率(%)※1		7.50%	17.62%

※1 加权平均净资产收益率= $P0 / (E0 + NP \div 2 + E_i \times M_i \div M0 - E_j \times M_j \div M0 \pm E_k \times M_k \div M0)$

## (2) 每股收益的计算过程

项目名称	项目号	2016 年度	2015 年度
归属于公司普通股股东的净利润	P0 (I)	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88
扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益		14,165,259.25	10,300,931.11
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	P0 (II)	1,484,123,247.13	2,698,193,970.77
发行在外的普通股加权平均数	S	2,975,000,000.00	2,700,000,000.00
期初股份总数	S0	2,700,000,000.00	2,700,000,000.00
报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	S1	-	-
报告期因发行新股或债转股等增加股份数	Si	300,000,000.00	-
报告期因回购等减少股份数	Sj	-	-
报告期缩股数	Sk	-	-
报告期月份数	M0	12.00	12.00
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	Mi	11.00	-
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	Mj	-	-
扣除非经常性损益前每股收益※1		0.50	1.00
扣除非经常性损益后每股收益※1		0.50	1.00
已确认为费用的稀释性潜在普通股股利		-	-
所得税税率		25.00%	25.00%
转换费用		-	-
可转换公司债券、认股权证、股份期权等转换或行权而增加的股份数		-	-
扣除非经常性损益前稀释每股收益※2		0.50	1.00
扣除非经常性损益后稀释每股收益※2		0.50	1.00

※1 基本每股收益= $P0 \div S$  (其中  $S=S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk$ )

※2 稀释每股收益= $P1 / (S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk + \text{认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数})$

(其中 P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润,并考虑稀释性潜在普通股对其影响,按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时,考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响,按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益,直至稀释每股收益达到最小值。)

**3、主要会计报表项目的异常情况及原因****(1) 资产负债表项目**

单位：元

项目	期末余额	期初余额	增减金额	增减比例	变动原因
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,769,705,706.86	14,222,827,510.80	7,546,878,196.06	53.06%	注 1
买入返售金融资产	16,980,151,202.32	8,923,142,748.05	8,057,008,454.27	90.29%	注 2
其他负债	14,909,393,126.03	6,877,015,079.34	8,032,378,046.69	116.80%	注 3
资本公积	11,764,002,886.47	8,564,676,213.93	3,199,326,672.54	37.35%	注 4

注 1：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产增加主要是由于公司期末债券投资规模较年初大幅增加所致。

注 2：买入返售金融资产增加主要是由于公司股权质押回购业务、债券质押回购业务和债券买断式回购融出资金规模大幅度增加所致。

注 3：其他负债增加主要是由于本期纳入合并范围的结构化主体中应付其他投资者的负债增加所致。

注 4：资本公积增加主要是公司本期定向增发新股，股本溢价增加所致。

**(2) 利润表项目**

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额	增减金额	增减比例	变动原因
手续费及佣金净收入	2,801,936,935.76	3,821,609,158.46	-1,019,672,222.70	-26.68%	注 1
其中：经纪业务手续费净收入	1,300,163,518.11	2,646,254,123.37	-1,346,090,605.26	-50.87%	注 2
公允价值变动收益	-495,181,738.10	306,628,570.68	-801,810,308.78	-261.49%	注 3
业务及管理费	1,831,121,366.35	2,656,099,023.42	-824,977,657.07	-31.06%	注 4
所得税费用	481,386,540.90	923,973,390.23	-442,586,849.33	-47.90%	注 5

注 1：手续费及佣金净收入减少主要是由于经纪业务手续费净收入较上期大幅减少所致。

注 2：经纪业务手续费净收入减少主要是由于本期股市交易活跃度下降，经纪交易量减少所致。

注 3：公允价值变动收益减少主要是由于本期公司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较上期大幅减少所致。

注 4：业务及管理费减少主要是本期公司经营业绩有所下滑，计提的工资、奖金和绩效较上期大幅减少所致。

注 5：所得税费用减少主要是由于本期税前利润大幅度下降所致。

## 第十二节 备查文件目录

备查文件目录	载有法定代表人签名的半年度报告文本
备查文件目录	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财务报告原文
备查文件目录	其他有关资料

董事长：范力

董事会批准报送日期：2017-04-06

### 修订信息

适用 不适用

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

适用 不适用

时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
2016-1-11	关于核准方敏证券公司监事会主席任职资格的批复	苏证监机构字[2016]8号
2016-2-14	关于朱卫国拟任东吴证券股份有限公司合规负责人的无异议函	苏证监函[2016]57号
2016-2-3	关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复	苏证监机构字[2016]35号
2016-4-20	关于酆美英证券公司监事任职资格的批复	苏证监机构字[2016]92号
2016-4-28	关于裴平证券公司独立董事任职资格的批复	苏证监机构字[2016]101号
2016-5-12	关于核准东吴证券股份有限公司设立14家分支机构的批复	苏证监机构字[2016]114号
2016-6-12	关于核准东吴证券股份有限公司在香港特别行政区设立东吴证券(香港)金融控股有限公司的批复	证监许可[2016]1266号
2016-7-21	关于核准东吴证券股份有限公司设立6家分支机构的批复	苏证监机构字[2016]251号
2016-9-19	关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复	苏证监机构字[2016]259号
2016-12-21	关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复	苏证监机构字[2016]270号

### 二、监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

公司在2014、2015、2016年分类评价结果分别为B类BBB级、A类A级、A类A级。