

国信证券股份有限公司  
2018 年第一季度报告



2018 年 4 月

## 第一节 重要提示

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

所有董事均已出席审议本次季报的董事会会议。

公司负责人何如、主管会计工作负责人及会计机构负责人周中国声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

# 目录

|                  |    |
|------------------|----|
| 第一节 重要提示 .....   | 1  |
| 第二节 公司基本情况 ..... | 3  |
| 第三节 重要事项 .....   | 6  |
| 第四节 财务报表 .....   | 10 |

## 第二节 公司基本情况

### 一、主要会计数据和财务指标（合并报表）

单位：人民币万元

| 项目            | 本报告期末<br>(2018年3月31日) | 上年度末<br>(2017年12月31日) | 本报告期末比上年度末<br>增减 |
|---------------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| 总资产           | 20,484,687.99         | 19,963,796.72         | 2.61%            |
| 归属于上市公司股东的净资产 | 5,291,385.62          | 5,208,066.37          | 1.60%            |

单位：人民币万元

| 项目                         | 本报告期<br>(2018年1-3月) | 上年同期<br>(2017年1-3月) | 本报告期比上年同期增减 |
|----------------------------|---------------------|---------------------|-------------|
| 营业收入                       | 233,717.66          | 260,198.85          | -10.18%     |
| 归属于上市公司股东的净利润              | 73,935.25           | 104,096.58          | -28.97%     |
| 归属于上市公司股东的扣除非<br>经常性损益的净利润 | 72,693.18           | 102,206.18          | -28.88%     |
| 经营活动产生的现金流量净额              | 294,188.33          | -239,876.21         | 222.64%     |
| 基本每股收益（元/股）                | 0.08                | 0.13                | -38.46%     |
| 稀释每股收益（元/股）                | 0.08                | 0.13                | -38.46%     |
| 加权平均净资产收益率                 | 1.41%               | 2.12%               | 下降0.71个百分点  |

根据2017年12月财政部发布的《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》（财会[2017]30号）（以下简称“通知”）和《关于一般企业财务报表格式有关问题的解读》，对于利润表新增的“资产处置收益”项目，企业应当按照《企业会计准则第30号——财务报表列报》等的相关规定，对可比期间的比较数据按照《通知》进行调整。上表调整了2017年1-3月“营业收入”的口径，新口径下“营业收入”包含“资产处置收益”项目的金额，调整金额为-50.89万元。

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| 截止本报告披露前一交易日公司总股本（股） | 8,200,000,000 |
| 最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股） | 0.08          |

单位：人民币万元

| 非经营性损益项目                                      | 2018年1-3月 | 说明           |
|---|-----------|--------------|
| 非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）                   | -39.38    | -            |
| 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） | 1,754.75  | 主要是收到各项政府补助。 |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益                         | -7.25     | -            |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出                            | -79.46    | -            |
| 减：所得税影响额                                      | 386.59    | -            |
| 合计  | 1,242.07  | -            |

证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、

衍生金融工具产生的公允价值变动损益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、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。

## 二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

### (一) 普通股股东总数和表决权恢复的优先股股东数量及前 10 名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末普通股股东总数                | 116,453 户     | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数 | 不适用           |              |         |
|----------------------------|---------------|-------------------|---------------|--------------|---------|
| <b>前 10 名股东持股情况</b>        |               |                   |               |              |         |
| 股东名称                       | 股东性质          | 持股比例              | 持股数量          | 持有有限售条件的股份数量 | 质押或冻结情况 |
| 深圳市投资控股有限公司                | 国有法人          | 33.53%            | 2,749,526,814 | -            | 无       |
| 华润深国投信托有限公司                | 国有法人          | 25.15%            | 2,062,145,110 | -            | 无       |
| 云南合和（集团）股份有限公司             | 国有法人          | 16.77%            | 1,374,763,407 | -            | 无       |
| 中国第一汽车集团公司                 | 国有法人          | 4.28%             | 350,564,669   | -            | 无       |
| 北京城建投资发展股份有限公司             | 境内非国有法人       | 4.18%             | 343,000,000   | -            | 无       |
| 中国证券金融股份有限公司               | 国有法人          | 0.84%             | 68,617,095    | -            | 无       |
| 全国社会保障基金理事会转持二户            | 国有法人          | 0.62%             | 50,473,186    | -            | 无       |
| 中央汇金资产管理有限责任公司             | 国有法人          | 0.60%             | 49,477,100    | -            | 无       |
| 工银瑞信基金—农业银行—工银瑞信中证金融资产管理计划 | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 博时基金—农业银行—博时中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 大成基金—农业银行—大成中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 华夏基金—农业银行—华夏中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 银华基金—农业银行—银华中证金融资产管理计划     | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| 易方达基金—农业银行—易方达中证金融资产管理计划   | 其他            | 0.34%             | 27,792,800    | -            | 无       |
| <b>前 10 名无限售条件股东持股情况</b>   |               |                   |               |              |         |
| 股东名称                       | 持有无限售条件股份数量   | 股份种类              |               |              |         |
|                            |               | 股份种类              | 数量            |              |         |
| 深圳市投资控股有限公司                | 2,749,526,814 | 人民币普通股            | 2,749,526,814 |              |         |
| 华润深国投信托有限公司                | 2,062,145,110 | 人民币普通股            | 2,062,145,110 |              |         |
| 云南合和（集团）股份有限公司             | 1,374,763,407 | 人民币普通股            | 1,374,763,407 |              |         |
| 中国第一汽车集团公司                 | 350,564,669   | 人民币普通股            | 350,564,669   |              |         |
| 北京城建投资发展股份有限公司             | 343,000,000   | 人民币普通股            | 343,000,000   |              |         |
| 中国证券金融股份有限公司               | 68,617,095    | 人民币普通股            | 68,617,095    |              |         |
| 全国社会保障基金理事会转持二户            | 50,473,186    | 人民币普通股            | 50,473,186    |              |         |

|                            |  |        |            |
|----------------------------|--|--------|------------|
| 中央汇金资产管理有限责任公司             | 49,477,100   | 人民币普通股 | 49,477,100 |
| 工银瑞信基金—农业银行—工银瑞信中证金融资产管理计划 | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 博时基金—农业银行—博时中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 大成基金—农业银行—大成中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 华夏基金—农业银行—华夏中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 银华基金—农业银行—银华中证金融资产管理计划     | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 易方达基金—农业银行—易方达中证金融资产管理计划   | 27,792,800   | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明           | 深圳市人民政府国有资产监督管理委员会（以下简称“深圳市国资委”）持有公司控股股东深圳市投资控股有限公司（以下简称“深投控”）100%股权，同时深圳市国资委还持有公司第二大股东华润深国投信托有限公司（以下简称“华润信托”）49%的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。 |        |            |
| 前10名普通股股东参与融资融券业务情况说明      | 无。   |        |            |

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

## （二）公司优先股股东总数及前 10 名优先股股东持股情况

公司未发行优先股。

## 第三节 重要事项

### 一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因（合并报表）

单位：人民币万元

| 项目                 | 2018年3月31日 | 2017年12月31日 | 同比增减幅度    | 变动原因  |
|--------------------|------------|-------------|-----------|---|
| 衍生金融资产             | 1,042.50   | 486.81      | 114.15%   | 主要是收益凭证公允价值变动。                                  |
| 存出保证金              | 310,286.76 | 234,910.47  | 32.09%    | 主要是存放于中国证券金融股份有限公司的信用交易保证金增加。                   |
| 衍生金融负债             | 12,295.45  | 8,906.57    | 38.05%    | 主要是场外期权公允价值变动。                                  |
| 应交税费               | 35,678.71  | 65,306.93   | -45.37%   | 主要是预缴企业所得税。                                     |
| 应付利息               | 53,200.02  | 32,071.56   | 65.88%    | 主要是短期融资款应付利息增加。                                 |
| 项目                 | 2018年1-3月  | 2017年1-3月   | 同比增减幅度    | 变动原因  |
| 投资收益               | 35,316.26  | 9,416.95    | 275.03%   | 主要是本期金融资产投资收益增加。                                |
| 公允价值变动收益（损失以“-”列示） | -5,472.29  | 33,635.16   | -116.27%  | 证券市场波动导致金融工具公允价值变动。                             |
| 汇兑收益（损失以“-”列示）     | 71.21      | -1,806.66   | 103.94%   | 主要是汇率变动所致。                                      |
| 其他收益               | 151.18     | -           | -         | 主要是收到的与日常活动相关的政府补助在“其他收益”单独列示。                  |
| 资产减值损失             | 13,785.46  | 3,050.83    | 351.86%   | 主要是可供出售金融资产减值损失增加。                              |
| 营业外收入              | 1,528.86   | 2,781.57    | -45.04%   | 主要是收到政府补助减少。                                    |
| 营业外支出              | 91.78      | 221.06      | -58.48%   | 主要是本期非常损失减少。                                    |
| 所得税费用              | 19,408.02  | 31,322.80   | -38.04%   | 主要是利润总额减少。                                      |
| 少数股东损益（损失以“-”列示）   | 347.57     | -16.84      | 2,163.95% | 主要是本期子公司国信弘盛创业投资有限公司（以下简称“国信弘盛”）合并利润表的少数股东损益增加。 |
| 其他综合收益的税后净额        | 9,400.28   | 22,562.71   | -58.34%   | 主要是可供出售金融资产公允价值变动损益减少。                          |
| 综合收益总额             | 83,683.10  | 126,642.44  | -33.92%   | 主要是本期净利润及其他综合收益减少。                              |
| 基本每股收益（元/股）        | 0.08       | 0.13        | -38.46%   | 本期净利润减少。  |
| 经营活动产生的现金流量净额      | 294,188.33 | -239,876.21 | 222.64%   | 主要是客户资金流出减少。                                    |
| 投资活动产生的现金流量净额      | 797.12     | -11,357.00  | 107.02%   | 主要是收回投资收到的现金增加。                                 |

## 二、重要事项进展情况及影响和解决方案的分析说明

### （一）公司 2015 年度配股事项的进展情况

2015年5月19日，公司2014年度股东大会审议通过公司2015年度配股相关议案。

2015年6月18日，中国证监会决定受理公司2015年度配股申请。

2015年11月26日，公司收到中国证监会《调查通知书》（稽查总队调查通字[153145]号），因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司立案调查。根据《中国证券监督管理委员会行政许可实施程序规定》相关规定，公司于2016年1月8日向中国证监会申请中止审核2015年度配股。

2016年1月22日，中国证监会同意公司中止审查申请。公司后续将依据中国证监会立案调查结果，决定申请恢复审核或终止审核配股事项。

2016年5月20日，公司2015年度股东大会审议通过将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案。

2017年4月17日，公司第三届董事会第四十次会议审议通过将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案。

2018年4月23日，公司第四届董事会第五次会议审议通过将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案。

上述事项公告详见公司于2015年4月29日、5月16日、5月20日、6月23日，2016年1月23日、5月21日，2017年4月18日，2018年4月24日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

### （二）关于报告期内债券发行及兑付兑息事项

根据公司于2017年8月7日取得的深圳证券交易所《关于国信证券股份有限公司2017年非公开发行公司债券符合深交所转让条件的无异议函》（深证函[2017]393号），公司在报告期内先后完成发行国信证券股份有限公司2018年非公开发行公司债券（第一期）（债券简称“18国信01”，债券代码“114288”），发行规模23亿元，最终票面年利率5.55%；完成发行国信证券股份有限公司2018年非公开发行公司债券（第二期）（债券简称“18国信02”，债券代码“114299”），发行规模20亿元，最终票面年利率5.40%。上述事项公告详见公司分别于2018年1月20日、2018年2月27日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

2018年3月19日，公司完成国信证券股份有限公司2015年第二期次级债券（债券简称“15国信02”，债券代码“118920”）兑付兑息，该期债券已于2018年3月15日摘牌。上述事项公告详见公司于2018年3月15日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

### （三）关于收到中国证监会《调查通知书》事项

2018年1月30日收到中国证监会《调查通知书》（成稽调查通字[18001]号）。因公司保荐业务及财务顾问业务涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立

案调查。

上述事项公告详见公司于2018年1月31日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

#### (四) 关于聘任公司总裁及合规总监、公司副总裁及其他高级管理人员相关事项

2018年3月28日，公司第四届董事会第四次会议审议通过《关于聘任公司总裁和合规总监的议案》及《关于聘任公司副总裁和其他高级管理人员的议案》，同意聘任岳克胜先生担任公司总裁；聘任陈勇先生担任公司合规总监；聘任胡华勇先生、陈华先生、杜海江先生担任公司副总裁；聘任袁超先生担任公司首席投资官；聘任曾信先生担任公司首席风险官；聘任刘汉西先生担任公司首席工程师。

上述事项公告详见公司于2018年3月29日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

#### (五) 营业网点的情况

截至报告期末，公司共设有52家分公司，165家证券营业部，分布于全国119个中心城市地区。报告期内，公司营业网点的变更情况如下：

| 序号 | 变更类型  | 变更后  | 变更前   |
|----|-------|--|---|
| 1  | 迁址    | 牡丹江太平路证券营业部<br>地址：黑龙江省牡丹江市东安区太平路东日照街京江华府小区000104   | 牡丹江太平路证券营业部<br>地址：牡丹江市西安区太平路100号              |
| 2  | 迁址并更名 | 深圳中心路证券营业部<br>地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路3233号深圳湾一号T1C座6A602 | 深圳深南中路证券营业部<br>地址：深圳市福田区深南中路1099号平安银行大厦18、20楼 |
| 3  |       | 慈溪南城路证券营业部<br>地址：浙江省慈溪市浒山街道南城路59号（和美大厦）            | 慈溪新城大道证券营业部<br>地址：慈溪市白沙路街道嘉里商务大厦2号楼（10-3）室    |
| 4  |       | 蓬莱南关路证券营业部<br>地址：山东省烟台市蓬莱市登州街道南关路273-10号           | 蓬莱钟楼东路证券营业部<br>地址：山东省蓬莱市钟楼东路204号              |
| 5  | 更名    | 深圳福中分公司  | 深圳福中一路证券营业部                                   |

#### (六) 其他

| 序号 | 重要事项概述             | 披露日期       | 临时报告披露网站查询索引  |
|----|--------------------|------------|---|
| 1  | 深圳证监局核准变更公司章程重要条款。 | 2018年3月29日 | 详细请参见披露于深交所网站（ <a href="http://www.szse.cn">www.szse.cn</a> ）的公告。 |
| 2  | 设立另类投资子公司          | 2018年3月9日  |   |

### 三、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超期未履行完毕的承诺事项

不存在公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内超期未履行完毕的承诺事项。

#### 四、对 2018 年 1-6 月经营业绩的预计

不适用。

#### 五、以公允价值计量的金融资产

单位：人民币万元

| 资产类别   | 初始投资成本       | 公允价值变动损益   | 计入权益的累计公允价值变动 | 购入金额          | 售出金额          | 投资收益       | 期末金额         | 资金来源 |
|--------|--------------|------------|---------------|---------------|---------------|------------|--------------|------|
| 股票     | 862,233.24   | -20,848.26 | 85,469.38     | 485,710.83    | 489,352.74    | -12,228.41 | 845,752.65   | 自有   |
| 基金     | 304,874.25   | -884.47    | -323.23       | 1,992,053.59  | 1,838,433.35  | 6,232.63   | 300,730.49   | 自有   |
| 债券     | 3,402,963.59 | 14,243.28  | -1,720.43     | 12,739,585.64 | 12,561,979.31 | 36,063.38  | 3,374,297.67 | 自有   |
| 信托产品   | 44,333.24    | -1,757.64  | 46.51         | 8,745.13      | 2,850.00      | 0.00       | 45,136.91    | 自有   |
| 金融衍生工具 | -            | 4,168.88   | -             | -             | -             | -2,746.26  | -11,252.95   | 自有   |
| 其他     | 1,028,529.39 | -394.08    | 76,847.08     | 72,853.66     | 95,716.84     | 885.03     | 1,105,139.94 | 自有   |
| 合计     | 5,642,933.71 | -5,472.29  | 160,319.31    | 15,298,948.85 | 14,988,332.24 | 28,206.37  | 5,659,804.71 | -    |

注：本表所述的公允价值变动损益、购入金额、售出金额、投资收益均为2018年1-3月期间累计金额。

#### 六、违规对外担保情况

报告期内，公司无违规对外担保情况。

#### 七、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，不存在控股股东及其关联方非经营性占用公司资金的情况。

#### 八、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

| 接待时间       | 接待方式 | 接待对象类型 | 接待对象  |
|------------|------|--------|---|
| 2018年1月19日 | 实地调研 | 机构     | 华泰证券股份有限公司<br>华创证券股份有限公司<br>山西证券股份有限公司<br>阿巴马资产管理有限公司<br>华润元大基金管理有限公司<br>金鹰基金资产管理有限公司<br>富德生命人寿保险股份有限公司 |

公司已在深交所互动易平台国信证券专网的投资者关系专区及公司官网就上述调研活动披露投资者关系活动记录表。

## 第四节 财务报表

### 一、财务报表

#### (一) 合并资产负债表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                     | 2018 年 3 月 31 日           | 2017 年 12 月 31 日          |
|------------------------|---------------------------|---------------------------|
| <b>资产：</b>             |                           |                           |
| 货币资金                   | 42,738,063,703.68         | 40,039,538,427.43         |
| 其中：客户存款                | 39,728,634,403.07         | 34,956,365,293.47         |
| 结算备付金                  | 5,932,101,806.89          | 7,427,365,616.24          |
| 其中：客户备付金               | 4,811,539,001.16          | 6,666,725,114.92          |
| 融出资金                   | 38,332,938,366.13         | 40,144,388,273.90         |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 34,720,974,592.37         | 32,278,598,121.89         |
| 衍生金融资产                 | 10,425,007.35             | 4,868,106.75              |
| 买入返售金融资产               | 46,037,988,832.19         | 44,724,191,931.12         |
| 应收款项                   | 1,092,701,497.03          | 919,579,255.59            |
| 应收利息                   | 2,462,369,868.42          | 2,149,360,714.27          |
| 存出保证金                  | 3,102,867,579.60          | 2,349,104,659.46          |
| 可供出售金融资产               | 23,215,559,247.09         | 22,354,500,666.22         |
| 长期股权投资                 | 2,758,348,212.05          | 2,754,191,798.28          |
| 投资性房地产                 | 145,123,216.42            | 146,286,143.83            |
| 固定资产                   | 1,435,699,278.60          | 1,462,896,441.65          |
| 在建工程                   | 491,794,883.54            | 416,967,415.70            |
| 无形资产                   | 618,178,973.30            | 622,309,206.16            |
| 商誉                     | 10,260,249.61             | 10,260,249.61             |
| 递延所得税资产                | 1,479,245,331.29          | 1,569,986,045.00          |
| 其他资产                   | 262,239,303.12            | 263,574,108.03            |
| <b>资产总计</b>            | <b>204,846,879,948.68</b> | <b>199,637,967,181.13</b> |
| <b>负债：</b>             |                           |                           |
| 短期借款                   | 852,153,703.20            | 846,356,200.00            |
| 应付短期融资款                | 18,354,084,000.00         | 17,483,792,000.00         |
| 拆入资金                   | 8,300,000,000.00          | 8,000,000,000.00          |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 684,291,158.32            | 544,616,300.79            |
| 衍生金融负债                 | 122,954,495.50            | 89,065,661.04             |
| 卖出回购金融资产款              | 24,888,717,689.40         | 21,514,056,764.35         |
| 代理买卖证券款                | 41,628,828,684.14         | 38,578,426,195.94         |
| 应付职工薪酬                 | 3,535,080,605.66          | 4,063,454,189.47          |

|                   |                           |                           |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| 应交税费              | 356,787,121.02            | 653,069,348.77            |
| 应付款项              | 9,264,690,667.13          | 9,990,029,302.86          |
| 应付利息              | 532,000,187.89            | 320,715,574.20            |
| 预计负债              | 126,041,186.70            | 126,041,186.70            |
| 应付债券              | 38,373,975,999.60         | 40,433,150,467.19         |
| 递延收益              | 139,324,138.17            | 140,193,103.68            |
| 递延所得税负债           | 420,354,223.06            | 384,400,625.04            |
| 其他负债              | 4,287,721,333.56          | 4,327,393,797.87          |
| <b>负债合计</b>       | <b>151,867,005,193.35</b> | <b>147,494,760,717.90</b> |
| <b>所有者权益：</b>     |                           |                           |
| 股本                | 8,200,000,000.00          | 8,200,000,000.00          |
| 其他权益工具            | 5,222,465,753.43          | 5,150,958,904.11          |
| 其中：优先股            |                           |                           |
| 永续债               | 5,222,465,753.43          | 5,150,958,904.11          |
| 资本公积              | 6,768,956,986.85          | 6,769,119,701.53          |
| 其他综合收益            | 1,404,923,619.35          | 1,310,920,859.74          |
| 盈余公积              | 4,212,265,617.55          | 4,212,265,617.55          |
| 一般风险准备            | 9,992,740,514.33          | 9,992,721,044.78          |
| 未分配利润             | 17,112,503,756.16         | 16,444,677,529.48         |
| 归属于母公司所有者权益合计     | 52,913,856,247.67         | 52,080,663,657.19         |
| 少数股东权益            | 66,018,507.66             | 62,542,806.04             |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>52,979,874,755.33</b>  | <b>52,143,206,463.23</b>  |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>204,846,879,948.68</b> | <b>199,637,967,181.13</b> |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## （二）母公司资产负债表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                     | 2018年3月31日        | 2017年12月31日       |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>             |                   |                   |
| 货币资金                   | 37,237,102,226.40 | 34,272,870,692.52 |
| 其中：客户存款                | 35,540,086,790.40 | 30,776,602,951.24 |
| 结算备付金                  | 5,638,667,926.92  | 7,146,865,808.95  |
| 其中：客户备付金               | 4,493,776,432.47  | 6,371,870,880.63  |
| 融出资金                   | 37,898,341,708.48 | 39,768,403,081.79 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 28,644,292,275.76 | 25,267,104,717.82 |
| 衍生金融资产                 | 8,314,592.98      | 4,868,106.75      |
| 买入返售金融资产               | 42,474,435,027.17 | 40,810,618,091.00 |
| 应收款项                   | 845,457,020.53    | 752,981,726.19    |
| 应收利息                   | 2,253,464,017.30  | 1,941,047,060.24  |
| 存出保证金                  | 1,653,065,833.38  | 835,203,674.28    |
| 可供出售金融资产               | 22,318,151,684.24 | 21,848,306,756.13 |

|                        |                           |                           |
|------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 长期股权投资                 | 5,838,754,217.09          | 5,786,117,504.89          |
| 投资性房地产                 | 161,873,251.34            | 163,198,627.07            |
| 固定资产                   | 1,396,412,318.72          | 1,422,989,080.50          |
| 在建工程                   | 491,794,883.54            | 416,967,415.70            |
| 无形资产                   | 610,486,432.06            | 614,701,636.87            |
| 递延所得税资产                | 1,323,723,956.28          | 1,345,060,535.43          |
| 其他资产                   | 246,626,174.45            | 248,010,449.99            |
| <b>资产总计</b>            | <b>189,040,963,546.64</b> | <b>182,645,314,966.12</b> |
| <b>负债：</b>             |                           |                           |
| 短期借款                   | -                         | -                         |
| 应付短期融资款                | 18,354,084,000.00         | 17,483,792,000.00         |
| 拆入资金                   | 8,300,000,000.00          | 8,000,000,000.00          |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 50,340,750.00             | -                         |
| 衍生金融负债                 | 120,844,081.13            | 89,065,661.04             |
| 卖出回购金融资产款              | 23,778,056,046.89         | 20,747,863,619.18         |
| 代理买卖证券款                | 40,224,374,861.70         | 37,240,538,774.59         |
| 应付职工薪酬                 | 3,469,683,741.77          | 3,956,666,529.32          |
| 应交税费                   | 317,916,957.77            | 599,582,631.94            |
| 应付款项                   | 3,060,520,867.84          | 2,439,921,942.37          |
| 应付利息                   | 530,021,826.57            | 320,046,429.96            |
| 预计负债                   | 125,320,089.78            | 125,320,089.78            |
| 应付债券                   | 38,373,975,999.60         | 40,433,150,467.19         |
| 递延收益                   | 139,324,138.17            | 140,193,103.68            |
| 递延所得税负债                | 364,678,818.16            | 267,219,053.66            |
| 其他负债                   | 1,739,416.19              | 323,800.00                |
| <b>负债合计</b>            | <b>137,210,881,595.57</b> | <b>131,843,684,102.71</b> |
| <b>所有者权益：</b>          |                           |                           |
| 股本                     | 8,200,000,000.00          | 8,200,000,000.00          |
| 其他权益工具                 | 5,222,465,753.43          | 5,150,958,904.11          |
| 其中：优先股                 |                           |                           |
| 永续债                    | 5,222,465,753.43          | 5,150,958,904.11          |
| 资本公积                   | 6,768,956,986.85          | 6,769,119,701.53          |
| 其他综合收益                 | 1,100,621,773.43          | 841,455,222.68            |
| 盈余公积                   | 4,212,265,617.55          | 4,212,265,617.55          |
| 一般风险准备                 | 9,992,740,514.33          | 9,992,721,044.78          |
| 未分配利润                  | 16,333,031,305.48         | 15,635,110,372.76         |
| <b>所有者权益合计</b>         | <b>51,830,081,951.07</b>  | <b>50,801,630,863.41</b>  |
| <b>负债和所有者权益总计</b>      | <b>189,040,963,546.64</b> | <b>182,645,314,966.12</b> |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

### (三) 合并利润表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                                 | 2018 年 1-3 月            | 2017 年 1-3 月            |
|------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>一、营业收入</b>                      | <b>2,337,176,580.54</b> | <b>2,601,988,505.66</b> |
| 手续费及佣金净收入                          | 1,517,173,818.50        | 1,615,691,189.62        |
| 其中：经纪业务手续费净收入                      | 1,030,800,224.53        | 1,031,506,224.81        |
| 投资银行业务手续费净收入                       | 338,232,542.79          | 384,997,804.62          |
| 资产管理业务手续费净收入                       | 62,969,517.72           | 60,892,694.86           |
| 利息净收入                              | 498,521,739.72          | 554,481,522.53          |
| 投资收益                               | 353,162,579.93          | 94,169,460.38           |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益                 | 68,120,537.31           | 82,675,928.95           |
| 公允价值变动收益（损失以“-”列示）                 | -54,722,924.74          | 336,351,611.30          |
| 汇兑收益（损失以“-”列示）                     | 712,090.09              | -18,066,576.59          |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列）                  | -393,837.89             | -508,894.17             |
| 其他收益                               | 1,511,768.26            | -                       |
| 其他业务收入                             | 21,211,346.67           | 19,870,192.59           |
| <b>二、营业支出</b>                      | <b>1,414,638,908.75</b> | <b>1,273,568,189.17</b> |
| 税金及附加                              | 24,303,749.58           | 21,238,726.52           |
| 业务及管理费                             | 1,249,683,779.93        | 1,218,307,037.69        |
| 资产减值损失                             | 137,854,636.85          | 30,508,327.24           |
| 其他业务成本                             | 2,796,742.39            | 3,514,097.72            |
| <b>三、营业利润</b>                      | <b>922,537,671.79</b>   | <b>1,328,420,316.49</b> |
| 加：营业外收入                            | 15,288,563.68           | 27,815,745.04           |
| 减：营业外支出                            | 917,816.38              | 2,210,645.43            |
| <b>四、利润总额</b>                      | <b>936,908,419.09</b>   | <b>1,354,025,416.10</b> |
| 减：所得税费用                            | 194,080,171.92          | 313,228,031.97          |
| <b>五、净利润</b>                       | <b>742,828,247.17</b>   | <b>1,040,797,384.13</b> |
| （一）持续经营净利润                         | 742,828,247.17          | 1,040,797,384.13        |
| （二）终止经营净利润                         | -                       | -                       |
| 其中：归属于母公司所有者（或股东）的净利润              | 739,352,545.55          | 1,040,965,772.96        |
| 少数股东损益                             | 3,475,701.62            | -168,388.83             |
| <b>六、其他综合收益的税后净额</b>               | <b>94,002,759.61</b>    | <b>225,627,054.93</b>   |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额               | 94,002,759.61           | 225,627,054.93          |
| （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                 | 94,002,759.61           | 225,627,054.93          |

|                                     |                       |                         |
|-------------------------------------|-----------------------|-------------------------|
| 益                                   |                       |                         |
| 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 | 56,638,889.65         | 1,088,952.26            |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 | 51,918,618.23         | 226,886,403.35          |
| 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                       | -14,554,748.27        | -2,348,300.68           |
| 6. 其他                               | -                     | -                       |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额                 | -                     | -                       |
| <b>七、综合收益总额</b>                     | <b>836,831,006.78</b> | <b>1,266,424,439.06</b> |
| 其中：                                 |                       |                         |
| 归属于上市公司股东的综合收益总额                    | 833,355,305.16        | 1,266,592,827.89        |
| 归属于少数股东的综合收益总额                      | 3,475,701.62          | -168,388.83             |
| <b>八、每股收益</b>                       |                       |                         |
| (一) 基本每股收益                          | 0.08                  | 0.13                    |
| (二) 稀释每股收益                          | 0.08                  | 0.13                    |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

#### (四) 母公司利润表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                 | 2018年1-3月               | 2017年1-3月               |
|--------------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>一、营业收入</b>      | <b>2,361,934,348.65</b> | <b>2,615,565,428.49</b> |
| 手续费及佣金净收入          | 1,442,954,079.58        | 1,571,827,182.16        |
| 其中：经纪业务手续费净收入      | 974,759,484.60          | 970,177,590.96          |
| 投资银行业务手续费净收入       | 334,702,404.25          | 384,425,888.20          |
| 资产管理业务手续费净收入       | 62,348,712.13           | 89,728,787.06           |
| 利息净收入              | 474,691,006.46          | 576,992,197.75          |
| 投资收益               | 533,257,365.55          | 148,692,196.99          |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | 56,618,357.53           | 87,079,523.00           |
| 公允价值变动收益（损失以“-”列示） | -107,566,321.38         | 298,713,416.37          |
| 汇兑收益（损失以“-”列示）     | -3,725,115.31           | -485,571.16             |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列）  | -392,141.09             | -488,478.19             |
| 其他收益               | 1,497,968.26            | -                       |
| 其他业务收入             | 21,217,506.58           | 20,314,484.57           |
| <b>二、营业支出</b>      | <b>1,495,258,411.11</b> | <b>1,183,850,043.33</b> |
| 税金及附加              | 23,653,767.80           | 20,835,320.05           |
| 业务及管理费             | 1,164,663,351.72        | 1,131,133,979.57        |
| 资产减值损失             | 305,602,419.46          | 30,508,327.24           |
| 其他业务成本             | 1,338,872.13            | 1,372,416.47            |
| <b>三、营业利润</b>      | <b>866,675,937.54</b>   | <b>1,431,715,385.16</b> |

|                                     |                         |                         |
|-------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 加：营业外收入                             | 13,288,563.65           | 23,445,745.04           |
| 减：营业外支出                             | 912,687.45              | 374,589.43              |
| <b>四、利润总额</b>                       | <b>879,051,813.74</b>   | <b>1,454,786,540.77</b> |
| 减：所得税费用                             | 109,604,562.15          | 339,900,338.37          |
| <b>五、净利润</b>                        | <b>769,447,251.59</b>   | <b>1,114,886,202.40</b> |
| （一）持续经营净利润                          | 769,447,251.59          | 1,114,886,202.40        |
| （二）终止经营净利润                          | -                       | -                       |
| <b>六、其他综合收益的税后净额</b>                | <b>259,166,550.75</b>   | <b>205,513,112.27</b>   |
| （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                 | 259,166,550.75          | 205,513,112.27          |
| 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 | -3,818,930.65           | 1,088,952.26            |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 | 262,985,481.40          | 204,424,160.01          |
| 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                               | -                       | -                       |
| <b>七、综合收益总额</b>                     | <b>1,028,613,802.34</b> | <b>1,320,399,314.67</b> |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

### （五）合并现金流量表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                           | 2018年1-3月                | 2017年1-3月               |
|------------------------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>        |                          |                         |
| 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增加额 | -                        | 4,595,447,438.69        |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               | 3,343,908,102.52         | 3,344,484,051.61        |
| 拆入资金净增加额                     | 300,000,000.00           | 300,000,000.00          |
| 回购业务资金净增加额                   | 2,034,466,529.37         | -                       |
| 融出资金净减少额                     | 1,868,806,176.20         | 1,324,206,391.64        |
| 代理买卖证券收到的现金净额                | 3,050,402,488.20         | -                       |
| 收到其他与经营活动有关的现金               | 740,188,623.34           | 98,782,273.10           |
| <b>经营活动现金流入小计</b>            | <b>11,337,771,919.63</b> | <b>9,662,920,155.04</b> |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产支付净额   | 2,424,507,570.78         | -                       |
| 代理买卖证券支付的现金净额                | -                        | 4,458,732,487.30        |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               | 557,762,995.51           | 373,892,643.56          |

|                          |                          |                          |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 支付给职工及为职工支付的现金           | 1,467,329,882.13         | 1,547,651,473.72         |
| 支付的各项税费                  | 587,784,336.31           | 656,427,621.45           |
| 支付其他与经营活动有关的现金           | 3,358,503,797.27         | 5,024,978,005.78         |
| <b>经营活动现金流出小计</b>        | <b>8,395,888,582.00</b>  | <b>12,061,682,231.81</b> |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b>     | <b>2,941,883,337.63</b>  | <b>-2,398,762,076.77</b> |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>    |                          |                          |
| 收回投资所收到的现金               | 94,268,255.56            | -                        |
| 收到其他与投资活动有关的现金           | 515,481.30               | 482,196.71               |
| <b>投资活动现金流入小计</b>        | <b>94,783,736.86</b>     | <b>482,196.71</b>        |
| 投资支付的现金                  | -                        | 20,488,000.00            |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 | 86,812,550.46            | 93,564,230.19            |
| <b>投资活动现金流出小计</b>        | <b>86,812,550.46</b>     | <b>114,052,230.19</b>    |
| <b>投资活动产生的现金流量净额</b>     | <b>7,971,186.40</b>      | <b>-113,570,033.48</b>   |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>    |                          |                          |
| 取得借款收到的现金                | 115,796,399.18           | -                        |
| 发行债券收到的现金                | 7,759,160,000.00         | 7,262,981,000.00         |
| <b>筹资活动现金流入小计</b>        | <b>7,874,956,399.18</b>  | <b>7,262,981,000.00</b>  |
| 偿还债务支付的现金                | 9,150,952,399.18         | 8,013,984,000.00         |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金        | 406,114,103.31           | 637,158,284.97           |
| <b>筹资活动现金流出小计</b>        | <b>9,557,066,502.49</b>  | <b>8,651,142,284.97</b>  |
| <b>筹资活动产生的现金流量净额</b>     | <b>-1,682,110,103.31</b> | <b>-1,388,161,284.97</b> |
| <b>四、汇率变动对现金的影响</b>      | <b>-64,482,953.82</b>    | <b>-17,009,466.93</b>    |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>    | <b>1,203,261,466.90</b>  | <b>-3,917,502,862.15</b> |
| 加：期初现金及现金等价物余额           | 46,877,454,043.67        | 62,561,305,233.84        |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>    | <b>48,080,715,510.57</b> | <b>58,643,802,371.69</b> |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

### （六）母公司现金流量表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目                           | 2018年1-3月                | 2017年1-3月               |
|------------------------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>        |                          |                         |
| 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增加额 | -                        | 1,409,195,355.23        |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               | 3,167,080,061.03         | 3,042,481,786.76        |
| 拆入资金净增加额                     | 300,000,000.00           | 300,000,000.00          |
| 回购业务资金净增加额                   | 1,339,241,066.97         | 303,167,803.25          |
| 融出资金净减少额                     | 1,868,806,176.20         | 1,324,206,391.64        |
| 代理买卖证券收到的现金净额                | 2,983,836,087.11         | -                       |
| 收到其他与经营活动有关的现金               | 696,787,243.30           | 53,247,295.87           |
| <b>经营活动现金流入小计</b>            | <b>10,355,750,634.61</b> | <b>6,432,298,632.75</b> |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损             | 3,435,283,699.09         | -                       |

|                          |                          |                          |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 益的金融资产支付净额               |                          |                          |
| 代理买卖证券支付的现金净额            | -                        | 4,355,422,457.05         |
| 支付利息、手续费及佣金的现金           | 535,043,350.82           | 348,207,539.52           |
| 支付给职工及为职工支付的现金           | 1,385,793,562.80         | 1,462,549,121.89         |
| 支付的各项税费                  | 548,641,979.16           | 629,676,682.21           |
| 支付其他与经营活动有关的现金           | 1,787,922,339.60         | 2,558,792,753.79         |
| <b>经营活动现金流出小计</b>        | <b>7,692,684,931.47</b>  | <b>9,354,648,554.46</b>  |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b>     | <b>2,663,065,703.14</b>  | <b>-2,922,349,921.71</b> |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>    |                          |                          |
| 收回投资所收到的现金               | 304,604,800.00           | 965,902,200.00           |
| 取得投资收益收到的现金              | 300,000,000.00           | -                        |
| 收到其他与投资活动有关的现金           | 515,481.30               | 468,934.83               |
| <b>投资活动现金流入小计</b>        | <b>605,120,281.30</b>    | <b>966,371,134.83</b>    |
| 投资支付的现金                  | -                        | 249,200,000.00           |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 | 85,086,595.63            | 89,979,339.79            |
| <b>投资活动现金流出小计</b>        | <b>85,086,595.63</b>     | <b>339,179,339.79</b>    |
| <b>投资活动产生的现金流量净额</b>     | <b>520,033,685.67</b>    | <b>627,191,795.04</b>    |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>    |                          |                          |
| 发行债券收到的现金                | 7,759,160,000.00         | 7,262,981,000.00         |
| <b>筹资活动现金流入小计</b>        | <b>7,759,160,000.00</b>  | <b>7,262,981,000.00</b>  |
| 偿还债务支付的现金                | 9,076,437,000.00         | 8,013,984,000.00         |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金        | 406,114,103.31           | 637,158,284.97           |
| <b>筹资活动现金流出小计</b>        | <b>9,482,551,103.31</b>  | <b>8,651,142,284.97</b>  |
| <b>筹资活动产生的现金流量净额</b>     | <b>-1,723,391,103.31</b> | <b>-1,388,161,284.97</b> |
| <b>四、汇率变动对现金的影响</b>      | <b>-3,674,633.65</b>     | <b>4,476,814.11</b>      |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>    | <b>1,456,033,651.85</b>  | <b>-3,678,842,597.53</b> |
| 加：期初现金及现金等价物余额           | 40,830,286,501.47        | 54,726,757,404.34        |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>    | <b>42,286,320,153.32</b> | <b>51,047,914,806.81</b> |

法定代表人：何如

主管会计工作负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 二、审计报告

公司 2018 年第一季度财务报告未经审计。

国信证券股份有限公司

法定代表人：何如

董事会批准报送日期：2018年4月23日