

# 西南证券股份有限公司

## 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、没有董事、监事、高级管理人员对本报告内容的真实、准确和完整存在异议或无法保证。

#### 三、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
董事	李剑铭	因工作原因	廖庆轩

四、天健会计师事务所（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。

五、公司负责人吴坚、主管会计工作负责人李勇及会计机构负责人牟光全声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

#### 六、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：以公司截至2016年末总股本5,645,109,124股为基数，向全体股东每10股派发现金红利1.00元（含税），实际分配现金利润为564,510,912.40元。2016年末公司不进行资本公积金转增股本。本预案已经公司第八届董事会第二次会议审议通过，尚需提交股东大会审议。

#### 七、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本年度报告中涉及的未来计划、发展战略等前瞻性陈述，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。

#### 八、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

#### 九、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

#### 十、重大风险提示

适用 不适用

公司已在本年度报告中详述经营活动可能遇到的风险，具体参见“第四节经营情况讨论与分析”中“三、公司关于公司未来发展的讨论与分析”之“（四）可能面对的风险”部分。

#### 十一、其他

适用 不适用

## 目录

第一节	释义.....	3
第二节	公司简介和主要财务指标.....	4
第三节	公司业务概要.....	17
第四节	经营情况讨论与分析.....	20
第五节	重要事项.....	39
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	50
第七节	优先股相关情况.....	55
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	56
第九节	公司治理.....	65
第十节	公司债券相关情况.....	69
第十一节	财务报告.....	73
第十二节	备查文件目录.....	176
第十三节	证券公司信息披露.....	177

## 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		
西南证券、本公司、公司、母公司	指	西南证券股份有限公司
西南有限	指	原西南证券有限责任公司
*ST 长运	指	原重庆长江水运股份有限公司
重庆渝富	指	重庆渝富资产经营管理集团有限公司
中国建投	指	中国建银投资有限责任公司
重庆城投	指	重庆市城市建设投资（集团）有限公司
江北嘴集团	指	重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司
重庆高速	指	重庆高速公路集团有限公司
重庆水务资产	指	重庆市水务资产经营有限公司
银华基金	指	银华基金管理股份有限公司
西证投资	指	西证股权投资有限公司
西证创新	指	西证创新投资有限公司
西证国际	指	西证国际投资有限公司
西证国际证券	指	西证国际证券股份有限公司
西南期货	指	西南期货有限公司
重庆股份转让中心、重庆 OTC	指	重庆股份转让中心有限责任公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
重庆市国资委	指	重庆市国有资产监督管理委员会
公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站	指	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

公司的中文名称	西南证券股份有限公司
公司的中文简称	西南证券
公司的外文名称	Southwest Securities Co., Ltd.
公司的外文名称缩写	SWSC
公司的法定代表人	吴坚
公司总经理	吴坚

### 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	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00
净资本	14,791,810,687.33	14,806,744,654.46

### 公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

- 1、证券经纪业务资格
- 2、证券承销与保荐资格
- 3、证券资产管理业务资格
- 4、证券自营业务资格
- 5、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问资格
- 6、证券投资咨询资格
- 7、证券投资基金代销资格
- 8、融资融券业务资格
- 9、代销金融产品业务资格
- 10、保险资金受托管理业务资格
- 11、股票质押式回购业务资格
- 12、为期货公司提供中间介绍业务资格
- 13、直接投资业务资格
- 14、全国中小企业股份转让系统主办券商推荐业务和经纪业务资格
- 15、中小企业私募债券承销业务试点资格
- 16、证券经纪人制度实施资格
- 17、外币有价证券经纪业务资格
- 18、网上证券委托业务资格
- 19、公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格
- 20、公司资产管理业务参与股指期货交易资格

- 21、债券质押式报价回购业务资格
- 22、约定购回式证券交易业务资格
- 23、开放式证券投资基金代销业务资格
- 24、转融通业务资格
- 25、新股网下询价业务资格
- 26、利率互换交易资格
- 27、上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格
- 28、全国银行间同业拆借市场从事同业拆借业务资格
- 29、向保险机构投资者提供交易单元资格
- 30、代理证券质押登记业务资格
- 31、全国中小企业股份转让系统做市商业资格
- 32、沪港通下港股通业务资格
- 33、深港通下港股通业务资格
- 34、柜台市场业务试点资格
- 35、私募基金综合托管业务试点资格
- 36、互联网证券业务试点资格
- 37、股票期权经纪业务、自营业务及做市业务资格
- 38、期权结算业务资格
- 39、客户资金消费支付服务资格
- 40、上市公司股权激励行权融资业务试点资格
- 41、中国证券登记结算有限责任公司乙类结算参与者资格

公司还拥有上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券业协会、中国银行间市场交易商协会、中国证券投资基金业协会、中国期货业协会以及重庆股份转让中心的会员资格，亦具有中国国债协会理事级会员资格。

## 二、联系人和联系方式

	副总裁、董事会秘书	证券事务代表
姓名	徐鸣镝	王致贤
联系地址	重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦	重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
电话	023-63786433	023-63786433
传真	023-63786477	023-63786477
电子信箱	xmd@swsc.com.cn	wzx@swsc.com.cn

## 三、基本情况简介

公司注册地址	重庆市江北区桥北苑8号
公司注册地址的邮政编码	400023
公司办公地址	重庆市江北区桥北苑8号，西南证券大厦

公司办公地址的邮政编码	400023
公司网址	http://www.swsc.com.cn
电子信箱	dshb@swsc.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	重庆市江北区桥北苑8号，西南证券大厦公司办公室

#### 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	变更前股票简称
A股	上海证券交易所	西南证券	600369	*ST长运

#### 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

西南证券系经中国证监会批准，通过\*ST长运重大资产重组及吸收合并西南有限，并依法承继西南有限的各项证券业务资格设立的全国第9家上市证券公司。

西南有限是1999年12月28日经中国证监会证监机构字[1999]32号文、证监机构字[1999]114号文和证监机构字[1999]159号文批复，以原重庆国际信托投资有限公司证券部、原重庆市证券公司、原重庆有价证券公司和原重庆证券登记有限责任公司的全部净资产为基础，联合其他股东（均以现金出资）共同发起设立的有限责任公司。西南有限设立时注册资本为112,820.99万元。

2002年11月14日，经中国证监会证监机构字[2002]332号文批复，西南有限实施增资扩股，注册资本增至163,043.12万元。

2006年8月7日，经中国证监会证监机构字[2006]185号文批复，西南有限于2006年8月实施减资，股东和持股比例不变，注册资本由163,043.12万元减至81,521.56万元。

2006年10月23日，经中国证监会证监机构字[2006]250号文批复，西南有限实施增资扩股，注册资本由81,521.56万元增至233,661.56万元。

2009年2月，经中国证监会证监许可[2009]62号文批复，\*ST长运重大资产重组并以新增1,658,997,062股人民币普通股吸收合并西南有限，并依法承继西南有限的各项证券业务资格。公司名称变更为“西南证券股份有限公司”，注册资本变更为190,385.46万元。公司证券简称由“\*ST长运”变更为“西南证券”，证券代码为600369。

2010年5月21日，经中国证监会证监许可[2010]673号文核准，公司非公开发行人民币普通股41,870万股，并于2010年8月30日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成新增股份的登记托管手续，公司总股本（注册资本）增至2,322,554,562股（元）。

2013 年 12 月 6 日，经中国证监会证监许可[2013]1533 号文核准，公司非公开发行人民币普通股 50,000 万股，并于 2014 年 2 月 24 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成新增股份的登记托管手续，公司总股本（注册资本）增至 2,822,554,562 股（元）。

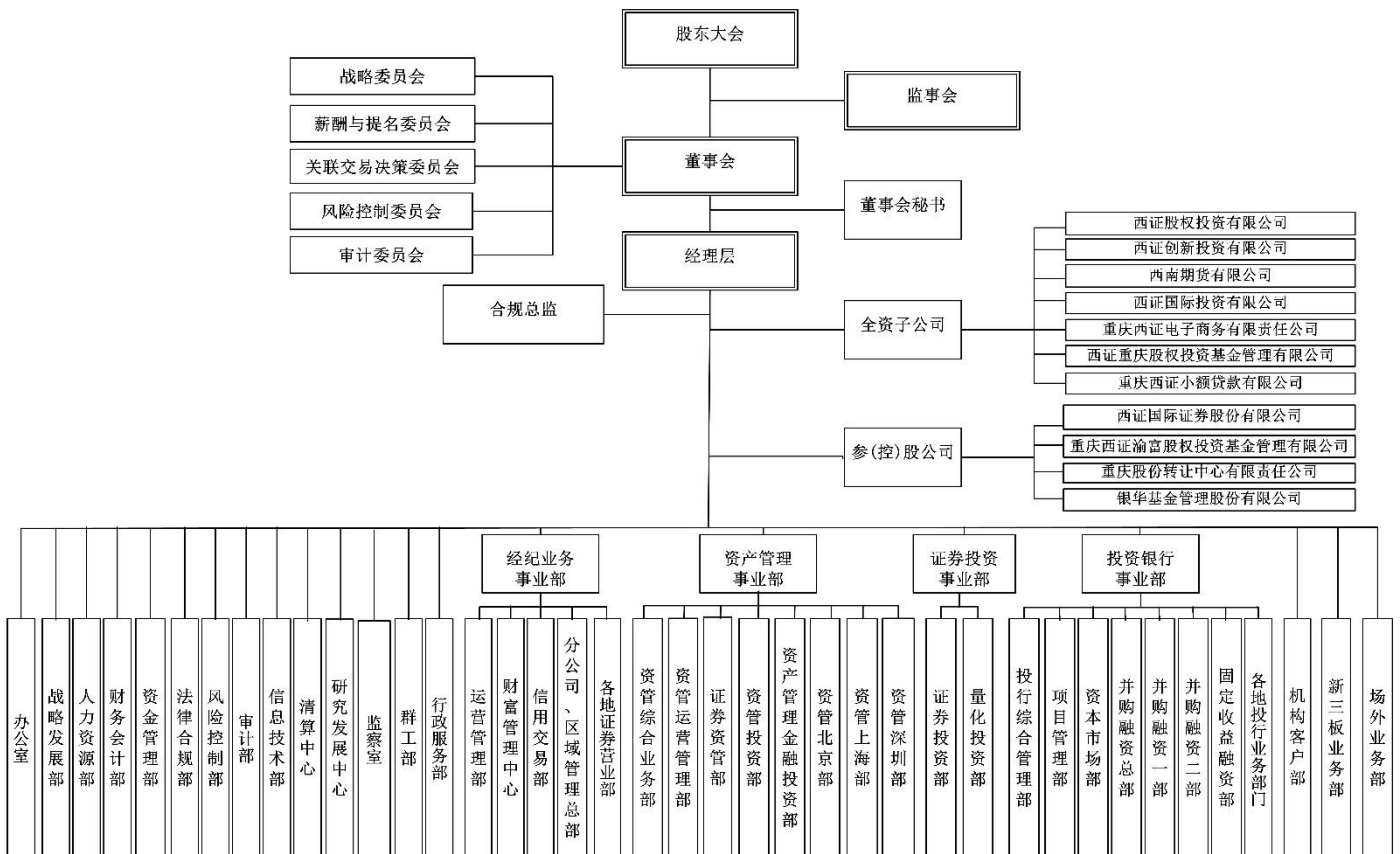
2015 年 9 月，根据公司 2015 年第四次临时股东大会通过的《关于公司 2015 年半年度利润分配及资本公积金转增股本预案的议案》，公司以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股，总股本相应增至 5,645,109,124 股，并于 2015 年 9 月 30 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成转增股份的登记托管手续，公司注册资本相应变更为 5,645,109,124 元。

## （二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

公司的法人治理结构科学合理，公司的组织构架符合公司发展的需要，并严格遵循《公司法》、《证券法》等规章制度及《公司章程》的规定。

公司组织机构图如下：



## （三）公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用

截至 2016 年 12 月 31 日，公司共拥有 128 家证券分支机构，其中：证券营业部 119 家，分公司 9 家（详见下表）。在区域分布上，公司在重庆地区有 44 家证券分支机构（实现了对重庆区县的全覆盖），其余 84 家证券分支机构分布在北京、上海、天津、广东、山东、山西、安徽、福建、甘肃、河北、河南、湖北、湖南、黑龙江、吉林、辽宁、内蒙古、四川、江苏、宁夏、青海、云南、浙江、江西、广西、陕西、贵州和新疆等全国 28 个省、直辖市及自治区。

序号	省份	证券营业部名称	运营状态
1	重庆	重庆沧白路证券营业部	运营中
2		重庆嘉陵桥西村证券营业部	运营中
3		重庆建新北路证券营业部	运营中
4		重庆大石坝七村证券营业部	运营中
5		重庆渝碚路证券营业部	运营中
6		重庆惠工路证券营业部	运营中
7		重庆杨家坪正街证券营业部	运营中
8		重庆春晖路证券营业部	运营中
9		重庆胜利路证券营业部	运营中
10		重庆金渝大道证券营业部	运营中
11		重庆南川河滨南路证券营业部	运营中
12		重庆万州高笋塘证券营业部	运营中
13		重庆涪陵滨江路证券营业部	运营中
14		重庆长寿证券营业部	运营中
15		重庆潼南证券营业部	运营中
16		重庆荣昌证券营业部	运营中
17		重庆垫江证券营业部	运营中
18		重庆合川希尔安大道证券营业部	运营中
19		重庆黄山大道证券营业部	运营中
20		重庆秀山证券营业部	运营中
21		重庆万盛大道证券营业部	运营中
22		重庆开州证券营业部	运营中
23		重庆永川红河大道证券营业部	运营中
24		重庆江津江州大道证券营业部	运营中
25		重庆巴南证券营业部	运营中
26		重庆大足证券营业部	运营中
27		重庆璧山名豪街证券营业部	运营中
28		重庆武隆建设东路证券营业部	运营中
29		重庆铜梁证券营业部	运营中
30		重庆忠县证券营业部	运营中
31		重庆丰都证券营业部	运营中
32		重庆黔江证券营业部	运营中
33		重庆酉阳证券营业部	运营中
34		重庆綦江证券营业部	运营中
35		重庆奉节永安路证券营业部	运营中
36		重庆梁平证券营业部	运营中
37		重庆云阳云江大道证券营业部	运营中
38		重庆石柱证券营业部	运营中
39		重庆彭水证券营业部	运营中



40		重庆巫山证券营业部	运营中
41		重庆巫溪证券营业部	运营中
42		重庆城口证券营业部	运营中
43		重庆第一分公司	运营中
44		重庆第二分公司	运营中
45	北京	北京北三环中路证券营业部	运营中
46		北京西城证券营业部	运营中
47		北京海淀证券营业部	运营中
48		北京昌平证券营业部	运营中
49		北京东城证券营业部	运营中
50		北京房山证券营业部	运营中
51		北京平谷证券营业部	运营中
52		北京分公司	运营中
53	天津	天津福安大街证券营业部	运营中
54	上海	上海普陀区平利路证券营业部	运营中
55		上海田林东路证券营业部	运营中
56		上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部	运营中
57		上海分公司	运营中
58	广东	广州天河路证券营业部	运营中
59		深圳滨河大道证券营业部	运营中
60		深圳深南大道证券营业部	运营中
61		中山中山四路证券营业部	运营中
62		深圳分公司	运营中
63	广西	柳州晨华路证券营业部	运营中
64		南宁中泰路证券营业部	运营中
65	浙江	杭州庆春东路证券营业部	运营中
66		温州汤家桥路证券营业部	运营中
67		金华丹溪路证券营业部	运营中
68		绍兴延安东路证券营业部	运营中
69		义乌城中中路证券营业部	运营中
70		宁波江东北路证券营业部	运营中
71		台州市府大道证券营业部	运营中
72		萧山市心北路证券营业部	运营中
73		浙江分公司	运营中
74	江西	南昌红谷中路大道证券营业部	运营中
75	江苏	徐州二环西路证券营业部	运营中
76		苏州仲英大道证券营业部	运营中
77		南京江东中路证券营业部	运营中
78		常熟海虞北路证券营业部	运营中
79		无锡青山西路证券营业部	运营中
80		昆山前进东路证券营业部	运营中
81	福建	福州井大路证券营业部	运营中
82		龙岩西陂路证券营业部	运营中
83	山东	济南黑虎泉西路证券营业部	运营中
84		淄博柳泉路证券营业部	运营中
85	河北	保定朝阳北大街证券营业部	运营中
86		唐山新华西道证券营业部	运营中
87	河南	郑州商务外环路证券营业部	运营中
88		郑州东风路证券营业部	运营中

89		安阳铁西路证券营业部	运营中
90		洛阳西苑路证券营业部	运营中
91		信阳东方红大道证券营业部	运营中
92	湖北	武汉中北路证券营业部	运营中
93		荆州北京路证券营业部	运营中
94	湖南	长沙芙蓉中路证券营业部	运营中
95		湘潭传奇路证券营业部	运营中
96		浏阳环府路证券营业部	运营中
97		岳阳通海南路证券营业部	运营中
98		郴州南岭大道证券营业部	运营中
99	山西	太原长治路证券营业部	运营中
100		运城学苑路证券营业部	运营中
101		大同迎宾街证券营业部	运营中
102	四川	成都天府大道证券营业部	运营中
103		攀枝花临江路证券营业部	运营中
104		德阳岷江西路证券营业部	运营中
105		绵阳安昌路证券营业部	运营中
106		乐山人民北路证券营业部	运营中
107		四川分公司	运营中
108	云南	昆明北京路证券营业部	运营中
109		曲靖麒麟南路证券营业部	运营中
110		富民环城南路证券营业部	运营中
111		大理云岭大道证券营业部	运营中
112	贵州	贵阳中山西路证券营业部	运营中
113	陕西	西安高新路证券营业部	运营中
114		西北分公司	运营中
115	甘肃	兰州南昌路证券营业部	运营中
116	安徽	合肥长江中路证券营业部	运营中
117		淮南龙湖中路证券营业部	运营中
118		当涂隆昌路证券营业部	运营中
119	青海	西宁五四大街证券营业部	运营中
120	辽宁	大连民主广场证券营业部	运营中
121		沈阳和平南大街证券营业部	运营中
122	吉林	长春康平街证券营业部	运营中
123	黑龙江	哈尔滨尚志大街证券营业部	运营中
124	宁夏	银川新华东街证券营业部	运营中
125		吴忠迎宾大街证券营业部	运营中
126	内蒙古	包头金融广场证券营业部	运营中
127		呼和浩特呼伦贝尔南路证券营业部	运营中
128	新疆	新疆分公司	运营中

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	杭州市江干区钱江路 1366 号华润大厦 B 座
	签字会计师姓名	李斌、陈丘刚

**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	3,631,659,620.90	8,496,799,180.16	-57.26	3,674,829,197.88
归属于母公司股东的净利润	917,572,729.00	3,554,650,541.89	-74.19	1,339,048,940.41
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	941,383,255.01	3,497,377,497.12	-73.08	1,325,351,708.05
经营活动产生的现金流量净额	-10,615,695,542.55	2,457,455,563.00	-531.98	5,575,305,755.34
其他综合收益	-179,319,796.13	-438,017,070.48		699,202,690.22
	2016年末	2015年末	本期末比上年同期末增减(%)	2014年末
资产总额	70,999,692,045.13	71,749,438,233.09	-1.04	58,202,555,187.69
负债总额	51,331,908,074.01	52,159,299,089.46	-1.59	40,982,558,807.94
归属于母公司股东的权益	19,001,272,142.71	19,017,736,045.79	-0.09	16,750,487,091.09
所有者权益总额	19,667,783,971.12	19,590,139,143.63	0.40	17,219,996,379.75
期末总股本	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00		2,822,554,562.00

**(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)	0.16	0.63	-74.60	0.24
稀释每股收益(元/股)	0.16	0.63	-74.60	0.24
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.17	0.62	-72.58	0.23
加权平均净资产收益率(%)	4.84	19.83	减少14.99个百分点	8.83
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	4.97	19.51	减少14.54个百分点	8.74

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

**(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	14,791,810,687.33	14,806,744,654.46
净资产	18,542,782,937.36	18,527,874,441.89
风险覆盖率(%)	268.11	276.45
资本杠杆率(%)	22.28	24.62
流动性覆盖率(%)	234.05	217.06
净稳定资金率(%)	148.96	145.64
净资本/净资产(%)	79.77	79.92
净资本/负债(%)	49.40	54.00

净资产/负债(%)	61.92	67.58
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本(%)	50.16	54.90
自营固定收益类证券/净资本(%)	109.47	128.92

注：此表数据为母公司口径，根据《证券公司年度报告内容与格式准则》和修订后的《证券公司风险控制指标管理办法》的规定，2015 年数据按照新标准重新计算列示。

### 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	727,324,057.35	1,275,629,164.50	950,524,937.53	678,181,461.52
归属于上市公司股东的净利润	343,819,480.65	516,549,195.02	196,192,503.13	-138,988,449.80
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	342,725,145.95	485,481,712.35	248,169,089.72	-134,992,693.01
经营活动产生的现金流量净额	-1,655,581,467.88	-10,399,786,424.54	-1,158,883,238.74	2,598,555,588.61

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（如适用）	2015 年金额	2014 年金额
非流动资产处置损益	102,394.85		370,818.62	-280,725.34
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	36,642,416.78		15,256,558.00	17,100,900.16
非货币性资产交换损益			8,246,089.71	
除上述各项之外的其他营业 外收入和支出	-67,809,443.05	主要系计提预计负 债 64,180,032.69 元	53,216,404.24	1,501,957.43
少数股东权益影响额	-842,639.82		-762,378.74	-64,088.22
所得税影响额	8,096,745.23		-19,054,447.06	-4,560,811.67

合计	-23,810,526.01		57,273,044.77	13,697,232.36
----	----------------	--	---------------	---------------

## 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	16,376,728,884.07	21,534,339,752.67	5,157,610,868.60	548,706,412.54
可供出售金融资产	9,507,042,013.45	10,876,585,466.99	1,369,543,453.54	311,788,423.53
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	3,772,653,089.25	5,490,490,745.17	1,717,837,655.92	-56,029,641.37
衍生金融工具	-164,107,630.04	-174,215,314.41	-10,107,684.37	10,790,847.65
合计	29,492,316,356.73	37,727,200,650.42	8,234,884,293.69	815,256,042.35

## 十三、其他

√适用 □不适用

按照《证券公司年度报告内容与格式准则》（2013年修订）的要求计算的主要财务数据和财务指标。

### (一)合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2016年12月31日	2015年12月31日	增减率(%)
货币资金	18,127,955,171.10	22,205,059,526.75	-18.36
结算备付金	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33	-17.87
融出资金	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91	-20.45
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,534,339,752.67	16,376,728,884.07	31.49
买入返售金融资产	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84	122.57
应收利息	538,898,651.77	414,863,179.56	29.90
存出保证金	625,158,757.97	998,317,476.91	-37.38
可供出售金融资产	11,632,792,839.82	10,169,611,118.09	14.39
持有至到期投资	99,441,565.00	293,602,122.20	-66.13
长期股权投资	1,621,964,192.55	1,655,217,844.00	-2.01
固定资产	335,328,716.71	315,975,350.79	6.12
在建工程	285,779,102.36	240,736,919.65	18.71
其他资产	733,221,648.33	1,583,697,811.77	-53.70
应付短期融资款	7,368,400,000.00	1,300,000,000.00	466.80
拆入资金		885,000,000.00	-100.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	5,490,490,745.17	3,772,653,089.25	45.53
卖出回购金融资产款	9,680,845,721.37	10,331,801,349.72	-6.30
代理买卖证券款	13,292,127,523.64	19,064,859,186.98	-30.28
应付职工薪酬	1,000,181,468.37	1,476,768,598.06	-32.27
应交税费	163,708,384.51	350,758,648.81	-53.33
应付利息	341,155,812.48	410,529,570.73	-16.90

预计负债	64,180,032.69		
应付债券	13,447,553,351.21	12,714,977,017.90	5.76
其他负债	155,743,389.49	877,714,897.42	-82.26
实收资本(或股本)	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00	
资本公积	7,852,067,958.06	7,852,067,958.06	
盈余公积	926,129,306.65	827,228,843.10	11.96
一般风险准备	1,775,278,624.90	1,577,477,697.80	12.54
未分配利润	2,760,152,434.68	2,873,145,282.45	-3.93
<b>利润表项目</b>	<b>2016 年度</b>	<b>2015 年度</b>	<b>增减率(%)</b>
营业收入	3,631,659,620.90	8,496,799,180.16	-57.26
手续费及佣金净收入	2,413,198,433.38	4,307,367,941.55	-43.98
利息净收入	34,370,191.52	213,841,229.09	-83.93
投资收益	1,370,586,687.23	3,948,018,572.82	-65.28
公允价值变动收益	-285,222,186.39	-65,146,630.45	
营业支出	2,474,064,211.40	4,230,702,247.50	-41.52
税金及附加	122,657,115.78	524,009,006.96	-76.59
业务及管理费	2,332,618,709.27	3,266,806,869.83	-28.60
资产减值损失	13,372,747.45	433,329,191.59	-96.91
营业利润	1,157,595,409.50	4,266,096,932.66	-72.87
营业外收入	40,369,136.90	87,757,668.69	-54.00
营业外支出	71,433,768.32	11,112,597.74	542.82
利润总额	1,126,530,778.08	4,342,742,003.61	-74.06
所得税费用	213,829,400.70	797,681,872.16	-73.19
净利润	912,701,377.38	3,545,060,131.45	-74.25

## (二)母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日	增减率(%)
货币资金	15,805,966,481.75	19,409,111,717.79	-18.56
结算备付金	2,838,128,517.04	3,166,121,271.22	-10.36
融出资金	7,825,820,017.29	9,406,397,089.04	-16.80
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	14,441,228,108.27	13,764,818,195.56	4.91
买入返售金融资产	2,533,907,230.66	789,731,663.84	220.86
应收利息	365,204,205.21	361,493,327.53	1.03
存出保证金	435,801,325.60	1,315,042,312.56	-66.86
可供出售金融资产	9,569,315,916.50	9,466,434,074.07	1.09
长期股权投资	5,623,130,547.35	4,626,984,198.80	21.53
固定资产	319,545,862.08	304,743,495.03	4.86
在建工程	285,779,102.36	240,736,919.65	18.71
其他资产	362,609,265.43	581,385,769.87	-37.63
应付短期融资款	7,368,400,000.00	1,300,000,000.00	466.80
拆入资金		885,000,000.00	-100.00
卖出回购金融资产款	8,939,845,721.37	10,331,801,349.72	-13.47
代理买卖证券款	12,298,424,590.05	17,870,995,226.80	-31.18
应付职工薪酬	920,304,584.29	1,378,351,930.53	-33.23
应交税费	147,640,191.69	303,963,131.57	-51.43
应付利息	331,051,642.36	402,148,595.68	-17.68

预计负债	71,636,032.69		
应付债券	11,963,437,167.47	11,245,549,193.17	6.38
实收资本（或股本）	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00	
资本公积	7,852,722,882.56	7,852,722,882.56	
盈余公积	926,129,306.65	827,228,843.10	11.96
一般风险准备	1,775,278,624.90	1,577,477,697.80	12.54
未分配利润	2,371,721,929.86	2,413,282,871.14	-1.72
<b>利润表项目</b>	<b>2016 年度</b>	<b>2015 年度</b>	<b>增减率（%）</b>
营业收入	3,447,347,645.85	7,639,628,035.12	-54.88
手续费及佣金净收入	2,336,700,951.57	4,219,622,574.50	-44.62
利息净收入	-50,213,036.04	248,435,212.47	-120.21
投资收益	1,295,713,275.32	3,112,599,455.71	-58.37
公允价值变动收益	-149,297,904.89	45,767,025.22	-426.21
营业支出	2,204,407,712.16	3,788,426,832.98	-41.81
税金及附加	94,632,122.02	491,567,131.32	-80.75
业务及管理费	2,040,891,852.82	2,980,492,189.38	-31.53
资产减值损失	64,562,170.96	310,591,934.97	-79.21
营业利润	1,242,939,933.69	3,851,201,202.14	-67.73
营业外收入	21,114,788.02	64,922,217.48	-67.48
营业外支出	78,375,126.10	10,477,239.24	648.05
利润总额	1,185,679,595.61	3,905,646,180.38	-69.64
所得税费用	196,674,960.12	690,148,073.29	-71.50
净利润	989,004,635.49	3,215,498,107.09	-69.24

### （三）比较式会计报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	期末数	期初数	变动幅度（%）	变动原因说明
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,534,339,752.67	16,376,728,884.07	31.49	本期并表结构化主体增加
买入返售金融资产	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84	122.57	本期股票质押式回购规模增加
应收款项	197,767,003.24	970,637,720.98	-79.63	期末应收清算款减少
存出保证金	625,158,757.97	998,317,476.91	-37.38	本期交易保证金减少
递延所得税资产	162,122,654.79	230,651,648.28	-29.71	本期应付职工薪酬产生的可抵扣暂时性差异减少
其他资产	733,221,648.33	1,583,697,811.77	-53.70	项目到期
应付短期融资款	7,368,400,000.00	1,300,000,000.00	466.80	发行短期公司债所致
拆入资金		885,000,000.00	-100.00	归还到期转融通融入款项
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	5,490,490,745.17	3,772,653,089.25	45.53	本期并表结构化主体增加
代理买卖证券款	13,292,127,523.64	19,064,859,186.98	-30.28	客户交易结算资金减少
应付职工薪酬	1,000,181,468.37	1,476,768,598.06	-32.27	本期计提职工薪酬减少
应付款项	139,615,260.36	656,112,350.76	-78.72	期末应付清算款减少
预计负债	64,180,032.69			预计诉讼赔偿支出
递延所得税负债	8,239,428.84	153,414,050.84	-94.63	计入其他综合收益的可供出售金融资产公允价值变动所致
其他负债	155,743,389.49	877,714,897.42	-82.26	项目到期
其他综合收益	42,534,694.42	242,707,140.38	-82.47	本期可供出售金融资产浮亏以

利润表项目	本期数	上期数	变动幅度(%)	变动原因说明
手续费及佣金净收入	2,413,198,433.38	4,307,367,941.55	-43.98	本期证券市场较2015年活跃程度降低,交易量大幅下降
利息净收入	34,370,191.52	213,841,229.09	-83.93	本期融资融券利息收入减少
投资收益	1,370,586,687.23	3,948,018,572.82	-65.28	本期金融工具持有期间以及处置实现的投资收益减少
公允价值变动收益	-285,222,186.39	-65,146,630.45		本期以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值浮亏所致
税金及附加	122,657,115.78	524,009,006.96	-76.59	应税收入减少以及营改增的影响
业务及管理费	2,332,618,709.27	3,266,806,869.83	-28.60	本期计提的职工薪酬减少
资产减值损失	13,372,747.45	433,329,191.59	-96.91	本期坏账损失以及长期股权投资损失减少
营业外收入	40,369,136.90	87,757,668.69	-54.00	主要系珠峰一号预计损失转回,导致上期金额较大
营业外支出	71,433,768.32	11,112,597.74	542.82	预计诉讼赔偿支出
所得税费用	213,829,400.70	797,681,872.16	-73.19	应纳税所得额减少



### 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

证券行业经过长期的发展、创新、规范，资本规模不断增强，收入结构持续改善，内控体系日益规范，整个行业总体保持稳步提升的态势，在国家经济战略中的地位得以提升，对实体经济发展的贡献也更加显著。同时，证券行业同质化竞争的特征仍然明显，传统的经纪、自营业务随二级市场大幅波动，投行、资管业务受经济周期的影响显著，行业内各公司之间的竞争进一步加强，行业整体盈利水平和利润率的波动较大。根据中国证券业协会发布的证券公司 2016 年度未经审计财务报表统计数据，截至 2016 年 12 月 31 日，国内 129 家证券公司总资产 5.79 万亿元，净资产 1.64 万亿元，净资本 1.47 万亿元，客户交易结算资金余额（含信用交易资金）1.44 万亿元，托管证券市值 33.77 万亿元，资产管理业务受托资金总额 17.82 万亿元。129 家证券公司在 2016 年度实现营业收入 3,279.94 亿元、净利润 1,234.45 亿元，其中 124 家实现盈利。展望来年，在经济下行寻底和监管全面加强的大背景下，在行业资产负债规模持续扩大的格局中，在业务创新拓展的同时，全面、扎实的合规风控能力将成为券商又一重要竞争力。

公司当前已逐步建立起全牌照、跨地域、多功能、一体化的综合金融服务模式，公司及子公司可以为个人及机构客户等提供多元化、全链条的产品及资本市场服务。公司主要业务包括证券及期货经纪业务、投资银行业务、自营业务、资产管理业务等。

公司证券及期货经纪业务主要为接受客户委托，按其要求代理买卖证券、期货，并向客户收取佣金，还包括金融产品销售、信用交易、投资顾问增值服务等。公司经纪业务围绕客户需求，以标准化的产品销售与定制服务为切入点，通过提高财富管理水平和增收创利，通过近几年的培育和发展，中间业务步入平稳发展轨道，综合金融服务及销售能力得到切实发展与提升。

公司投资银行业务主要为客户提供股权融资、债权融资，以及财务顾问等服务。公司投行延续精品投行发展模式，整体实力较强，业务较为均衡，其中再融资、并购重组业务长期处于市场领先地位，债券业务综合能力较强。

公司自营业务主要以自有资金在资本市场进行方向性投资和量化投资，业务品种主要包括权益类、固定收益类产品以及衍生品等。公司自营业务综合平衡回报率与风险控制需求，根据市场情况适时调整各类产品投资规模，以期取得合理的投资收益。

资产管理业务是指公司作为资产管理人，接受客户资产委托，为客户提供投资管理服务，以实现客户资产的保值增值。公司可为单一客户提供定向资产管理业务，为多个客户提供集合资产管理业务，为客户办理特定目的的专项资产管理业务，以及为外部私募资产管理业务提供投资建议服务。目前公司资产管理产品的种类涵盖债券、股债混合、定向增发、二级市场权益、量化、FOF、现金管理、股票质押式回购、资产证券化以及通道类品种。

公司还注重开展新三板业务，探索互联网金融业务等新型业务，并通过所属直接投资子公司、另类投资子公司、期货子公司、区域股权交易平台子公司、香港子公司等主体，开展直接股权投资业务、另类投资业务、跨境及海外融资业务、非上市公司股份登记托管和交易结算业务、商品及金融期货经纪、小额贷款等业务。

报告期内，公司业务呈现全产业链功能持续健全，业务架构完整且不断优化、重点突出、服务多样的综合金融发展模式，主要业务和经营模式在报告期内未发生重大变化。

## 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

√适用 □不适用

报告期末，公司资产总额为 710.00 亿元，较 2015 年末减少 1.04%。其中，占总资产规模比重较大的资产为货币资金、结算备付金、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、融出资金、买入返售金融资产、可供出售金融资产、长期股权投资，合计占总资产的比重为 95.07%，而期末余额变动较大的项目如下表所示：

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日	增减率 (%)	变动原因
货币资金	18,127,955,171.10	22,205,059,526.75	-18.36	两市交易量萎缩，客户资金显著减少
结算备付金	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33	-17.87	公司自有备付金减少
融出资金	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91	-20.45	两融规模减少所致
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,534,339,752.67	16,376,728,884.07	31.49	本期并表结构化主体增加
买入返售金融资产	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84	122.57	本期股票质押式回购规模增加
应收利息	538,898,651.77	414,863,179.56	29.90	本期债券投资利息增加
存出保证金	625,158,757.97	998,317,476.91	-37.38	本期交易保证金减少
在建工程	285,779,102.36	240,736,919.65	18.71	公司江北嘴大楼投资增加
其他资产	733,221,648.33	1,583,697,811.77	-53.70	项目到期

其中：境外资产 2,398,709,680.47（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 3.38%。

## 三、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

公司坚持以业务为中心，以业绩为导向，以贡献为标准，以合规风控为保障，紧抓外部机遇和行业调整的窗口期，深入推进市场化改革，稳中求进，持续优化盈利模式和发展质量，大力培育比较优势和核心竞争力。

### （一）全产业链的综合金融服务能力

经过持续发展，公司形成了较为全面的金融集团化架构，建立了包括证券、期货、直接投资、基金管理、小额贷款、区域股权交易、海外业务等的综合性证券金融服务体系，并在持续完善、优化中实现各业务条线的有效协同，逐步呈现强大的规模效应和整体销售、服务潜力。作为全牌照的综合金融服务提供者，公司已具备为客户提供全产业链、涉及客户各发

展阶段的金融产品 & 专业金融服务的能力，呈现出结构完整、重点突出、服务多样的综合金融发展模式。

#### （二）坚持市场化发展，充分发挥员工潜力

公司遵循证券行业客观规律，坚持市场化发展道路，持续从环境、人才、考核、机制、创新、实体经济服务等方面寻求新的突破，坚持以业务为中心、以业绩为导向，优化人、财、物等资源配置功能，通过不断增强市场化意识和氛围、完善市场化考核激励约束机制、探索市场化经营管理模式等，充分发掘员工服务公司发展的潜力及业务创新能力、增强业务联动能力，让员工充分分享公司改革发展成果，进而提升公司整体参与市场化竞争的能力和活力，推进公司业务的全面可持续发展。

#### （三）深耕重庆地区，发挥区域优势

作为唯一一家注册于重庆的综合型 A 股上市证券金融机构，在西部大开发、重庆长江上游区域性金融中心建设的大背景下，公司获得相对有利的地缘优势。截至报告期末，公司 119 家营业部已实现基本覆盖全国的营业网点体系，并形成对重庆区县全覆盖的优势，公司以服务实体经济、支持地方经济社会发展为切入点，不断深化与相关主体战略合作的深度和广度，形成了相对领先的区域市场地位。

#### （四）持续完善的公司治理机制

公司具有完善有效的现代企业法人治理架构和相适应的运行机制，公司“三会一层”（股东大会、董事会、监事会和经理层）在运作过程中相互分离、相互制衡，在各自的职权范围内各司其职、各负其责，确保了公司的规范运营和科学决策。公司通过在重要领域、业务条线建立专门委员会并赋予相应的职责权限，跟踪研究行业发展趋势，控制重大业务风险，将优化法人治理结构与促进业务发展有机结合，增强公司发展的软实力，确保公司及股东权益的保值增值。同时，结合不断完善合规管理和内部控制体系，持续强化全员合规风控意识，为公司未来持续健康发展提供了强大的内生推动力。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2016 年，世界政治经济格局依然动荡变化，欧美等经济发达国家新的政治经济政策对全球经济和资本市场产生一系列溢出效应。虽然世界经济增长前景未明，但中国坚持推进供给侧结构性改革，全年保持中高速增长（6.7%）。与此同时，全球主要股市普遍上涨，中国股市全年震荡下行，上证指数收于 3,104 点，下跌 12.31%；深证成指收于 10,177 点，下跌 19.64%。

报告期内，互联网金融的蓬勃发展持续冲击券商的经营模式，倒逼证券公司加快转型，加之深港通等多维资本开放的推进，行业竞争的分化与风口争夺加速升级。在依法从严全面监管的环境下，受 A 股市场震荡下跌、交易量大幅萎缩、券商创新步伐减缓等因素影响，证券公司业绩普遍大幅下滑。

在此背景下，公司稳健经营，强化风险管理，加快战略布局，探索多项改革，以业务为中心，对内深入挖潜，对外抢抓机遇，传统业务、创新业务融合发展，各业务链的经营生态不断完善，协同作战能力不断提升，全方位服务客户的模式不断改进，服务实体经济的能力不断增强，尽管受多重因素影响，公司业绩出现较大幅度下滑，但整体经营管理工作平稳有序，运营基础不断夯实。

### 二、报告期内主要经营情况

报告期内，公司实现营业收入 36.32 亿元，同比下降 57.26%；净利润 9.13 亿元，同比下降 74.25%。截至 2016 年 12 月 31 日，公司资产总额 710.00 亿元，所有者权益总额 196.68 亿元，母公司净资产 147.92 亿元，每股收益 0.16 元。在 2016 年 7 月公布的证券公司分类监管评级中，公司再获 A 类券商评级。

#### （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	3,631,659,620.90	8,496,799,180.16	-57.26
营业成本	2,474,064,211.40	4,230,702,247.50	-41.52
管理费用	2,332,618,709.27	3,266,806,869.83	-28.60
利润总额	1,126,530,778.08	4,342,742,003.61	-74.06
归属于母公司股东的净利润	917,572,729.00	3,554,650,541.89	-74.19
经营活动产生的现金流量净额	-10,615,695,542.55	2,457,455,563.00	-531.98
投资活动产生的现金流量净额	-363,605,565.48	-2,395,244,921.27	
筹资活动产生的现金流量净额	6,265,724,104.43	12,667,647,425.24	-50.54

## 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

报告期内，公司经纪业务、投行业务、资管业务、自营业务收入占公司总收入的比例分别为 27.62%、33.59%、5.15%和 23.82%。其中，公司投行业务、经纪业务收入占比较大，且投行业务收入占比较 2015 年度上升较多。从公司利润构成来看，报告期内，经纪业务、投行业务、资管业务、自营业务和其他业务的营业利润占比分别为 13.39%、82.80%、12.29%、60.18%及-68.66%。与上年同期相比，公司投行业务的营业利润占比大幅提升，自营业务与去年基本持平，而经纪业务与资管业务占比有所下降。

### (1) 主营业务分类别、分地区情况

单位:元 币种:人民币

主营业务分类别情况						
分类别	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 (%)
证券经纪业务	1,003,103,700.71	848,111,034.88	15.45	-62.62	-8.67	减少 49.94 个百分点
投资银行业务	1,219,814,961.81	261,290,623.50	78.58	-11.61	13.05	减少 4.67 个百分点
资产管理业务	187,007,474.01	44,766,988.61	76.06	-73.76	-36.62	减少 14.03 个百分点
证券自营业务	865,079,628.39	168,450,427.82	80.53	-68.97	-20.45	减少 11.88 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 (%)
华北	138,508,694.77	60,718,703.30	56.16	-57.94	-49.07	减少 7.63 个百分点
华东	221,584,556.19	101,821,199.79	54.05	-49.62	-49.02	减少 0.55 个百分点
中南	115,012,115.18	90,416,235.26	21.39	-48.97	-21.40	减少 27.58 个百分点
西南	3,121,714,757.66	2,012,047,294.27	35.55	-58.06	-45.25	减少 15.07 个百分点
西北	27,970,296.66	21,189,822.37	24.24	-45.62	-22.84	减少 22.36 个百分点
东北	9,837,863.87	12,267,977.15	-24.70	-30.90	-19.19	减少 18.07 个百分点
境外	-2,968,663.43	175,602,979.26			122.68	

#### 1) 主营业务分类别情况的说明

√适用 □不适用

##### ① 证券经纪业务

在市场交易量和佣金率双降的背景下，公司经纪业务聚焦业务转型，积极挖掘业务潜力。截至 2016 年 12 月 31 日，公司证券分支机构已达 128 家，客户总数 124.13 万户，同比增长 6%，交易市场份额 0.80%，交易排名较 2015 年提升 1 位至 31 名。信用交易业务方面，公司两融业务年日均市场份额 0.801%，年末份额 0.82%，行业排名较 2015 年末上升 1 位至 28 位；股票质押市场份额由 2015 年末的 0.601%提升至 0.761%，市场份额较 2015 年提升 5 名至 36 位；股票期权业务市场份额由 0.42%提升至 0.46%，市场份额较 2015 年提升 1 位至 31 位。通过推出两融及期权客户体验活动，积极开发增量客户，股票期权业务收入同比增长 93%，并实现所有营业部两融业务上线工作。

公司经纪业务团队在海外业务、财富管理方面也取得了进一步发展，围绕客户需求，以标准化的产品销售与定制服务为切入点，外引与内设相结合，不断丰富产品货架；同时针对高净值客户个性化需求，研究提供了包括产品定制、定制化签约、网下新股综合配套服务及全球资产配置服务，在满足客户财富管理需求基础上不断提升金融服务能力。

## ② 投资银行业务

2016年证券市场发生了较为深刻的变化，在依法监管、从严监管和全面监管的大背景下，监管机构出台了规范市场的一系列举措，对现有投资银行业务的市场业务类型和业务模式提出了更全面更严格的要求，也为投资银行业务带来了新的历史机遇。

公司充分发挥大投行平台融合股权、债权、并购三大类业务的优势，加大债券产品和业务的开发力度，加大对贫困地区企业发债的支持力度。同时，公司投行业务不断保持和巩固业务创新力度，加快发展出不同的新品种和新业务，在公司债、二级资本债、资产证券化、优先股、新三板、资产管理业务和股权质押等多项新业务上也取得了进一步的发展。在现有业务模式下，公司启动全面风险管理，强化事前自查机制，细化风险控制机制，力求提高项目管理质量，夯实风险控制工作，推动投行业务在合法合规的风险管控下稳健发展。

### a. 股权融资业务：

报告期内，公司完成IPO项目2个，再融资项目12个，累计承销金额230.35亿元，再融资发行家数在行业继续保持领先地位。

2016 年股权承销保荐业务详细情况表

项目类型	主承销金额（万元）	发行家数
首次公开发行	96,218.72	2
再融资发行	2,207,304.36	12
合计	2,303,523.08	14

### b. 债务融资业务：

2016年，企业债券市场保持平稳发展的态势，公司债业务保持了高速持续增长，其他品种依然保持良好发展势头。报告期内，投行累计完成债券主承销发行项目61个，累计承销金额605.32亿元。公司投行继续保持服务行业大客户的能力，成功为中国铁路总公司、国家电网公司等国内大型客户承销发行债券。

2016 年债券承销业务详细情况表

项目类型	主承销金额（万元）	发行家数
企业债券	979,369.43	12
公司债券	4,249,000.00	40
其他债券	824,800.00	9
合计	6,053,169.43	61

### c. 财务顾问业务

2016年，公司担任财务顾问并涉及发行股份的重大资产重组项目9家（按照证监会核准批复统计），在行业排名继续保持领先。报告期内，投行实现财务顾问收入5.32亿元。

公司在中国证券业协会对 2016 年度证券公司从事上市公司并购重组财务顾问业务执业能力专业评价中，继续获评为 A 类，连续四年保持行业对并购重组执业评价能力的最高评级。

2016 年，公司还获得证券时报评选的“2016 中国区最佳全能投行”、“2016 中国区最佳并购投行”、“2016 中国区最佳再融资投行”等多项荣誉称号。

### ③ 资产管理业务

2016 年，国内宏观经济保持中低位增长，年初 A 股在熔断机制等多重因素下重挫，沪指 1 月单月下跌 23%，全年窄幅震荡。债市 10 年期国债期货首次出现跌停，去年债券违约数量和规模是前两年总和的近 3 倍。证券公司资产管理行业则迎来了监管的重大转变，全面从严监管迫使行业转型、回归资管本源。在此背景下，公司资管以业务开拓与合规风控双管齐下，通过大力发展固定收益类产品，推动主动管理业务迅猛增长，为后续发展积累了后劲。

截至 2016 年末，公司本部资产管理业务在运产品 164 只，受托管理资金 1098 亿元，分别同比增长 62%和 24%。其中，在运主动管理产品 48 只，受托管理资金 274.9 亿元，分别同比增长 85%和 217%。在运定向通道产品 118 只，同比增长 55%，受托管理资金 823 亿元，与 2015 年基本持平。西南期货子公司资产管理在运产品 20 只，受托管理资金 5 亿元。

2016 年，公司资管主动管理业务发展迅猛，公司本部全年新增发行主动管理产品 35 只，新增管理规模 213 亿元。其中固定收益类产品增长最快，成为推动公司主动管理规模大幅增长的主动动力。2016 年公司本部新增发行固收类产品 22 只，新增规模 191 亿元。截至年末，在运固收类产品数量 25 只，规模 212 亿元，占公司本部资管主动管理规模的 77%，同比增长 1074%。去年西南期货子公司新增发行期货资产管理计划 20 只，新增受托管理资金 5 亿元。

2016 年，公司资产管理业务品种不断丰富，产品设计和投资管理能力进一步获得市场认可。去年公司本部新增发行资产支持专项计划 3 只，新增规模 12.7 亿元，其中“新东原物业资产支持专项计划”在首届中国资产证券化年度评选中荣获“2016 收费收益权最佳资产奖”。凭借债券方面的投资管理能力，取得工商银行总行、中信银行总行等多家银行委外业务，为多只债券类产品提供投资建议服务，产品规模超过 100 亿元。主动管理业务品种进一步覆盖到债券、定向增发、二级市场权益、量化、现金管理、资产证券化、债券增强、股债混合等类型。

### ④ 自营业务

在全年投资环境较为困难的背景下，公司证券自营业务继续履行维护市场稳定的承诺，并秉承稳健投资的理念，灵活调整大类资产配置，创造了绝对收益。方向性投资业务积极开展指数化投资管理，分散前期投资风险，在确保投资组合安全边际的前提下，稳健审慎地获得投资收益，投资收益率好于同期市场指数表现。量化投资业务积极应对市场和监管环境的巨大变化，投资重心向收益更有保证的利率互换及国债期货套保业务倾斜，持续丰富量化投

资策略，着力打造稳定安全的盈利模式，在量化投资业务整体收益率、固定收益衍生品交易规模、利率互换累计交易规模等多个指标上均位于行业前列。

### ⑤ 其他业务

2016 年，公司“全牌照”经营格局不断健全，综合金融服务能力逐步增强。报告期内，公司获批“上市公司股权激励行权融资业务试点”等创新业务资格，全产业链功能持续健全，保持结构完整、重点突出、服务多样的综合金融发展模式。

公司新三板业务发展壮大，累计签约 823 家企业；全年新增挂牌项目 156 个，同比增长 88%，排名市场第 6；累计挂牌数市场排名第 12。同时，为新三板客户提供融资、托管、财富管理等综合金融服务，共为 55 家企业完成 62 例新三板定增项目；融资总额 65 亿元，同比增长逾 5 倍，排名市场第 5。场外业务完成 4 笔规模逾 2000 万元的场外期权业务和 5 笔规模逾 3.5 亿元的收益凭证业务，累计储备场外股权融资目标企业 50 家，新增场外期权业务客户 17 家；积极开展互联网证券引流工作，初步完成银行、互联网企业等七大类渠道布局，引入客户逾 7500 户，新增资产 1.91 亿元；正式上线微证券移动互联网平台，荣获中国互联网协会 2016 年度金融科技创新榜产品创新奖；初步实现客户线下业务的线上化办理，完成互联网投教基地建设和金融商城建设。

公司投资研究能力持续增强，卖方服务的竞争力显著提升，品牌价值日益凸显，投研佣金连续第三年实现高速增长，2016 年创收投研佣金同比增长超 90%。核心团队的品牌影响力正在不断扩大，医药团队成功上榜“新财富最佳分析师”，化工团队先后斩获“天眼年度明星分析师”、“汤森路透行业最佳选股能力”、“水晶球最佳分析师第一名”等奖项，汽车团队也取得了“水晶球最佳分析师第五名”的成绩。

公司子公司业务链条积极拓展，多元金融体系效果凸显。截至 2016 年 12 月 31 日，西证股权投资有限公司及其下属机构管理的私募股权基金累计投资项目 33 个，投资总额约 13.2 亿元，报告期内共考察项目 235 个，新增奇虎 360 回归 A 股等 7 个股权投资项目。重庆西证电子商务有限责任公司积极打造西南证券综合金融产品的网上销售平台，通过“西证投融通”平台发布各类产品共 27 期，募集资金 2.13 亿元，平台注册客户数同比增加 23%。西证创新投资有限公司完成 8 亿元增资工作，全年完成投资项目 33 个，投资金额 16.7 亿元；通过开展股权投资、证券投资、主题基金投资、夹层投资等多种方式，扩充业务发展外延，拓宽业务收入来源。西证小额贷款有限公司积极化解存量贷款风险，深化内部营销和客户培养机制，并多维度确保新增贷款质量，全年新增贷款 90 笔，累计投放金额逾 2.27 亿元，均同比增长 70%以上。西南期货有限公司及时调整经营思路，商品期货经纪业务成交金额同比增长 37%，在运行 20 只期货资产管理计划，管理规模 5 亿元；成功升级中金所结算会员，并取得中国银行间市场交易商协会会员资格，进一步强化核心投资能力；积极筹建风险管理业务，推动信息化建设由技术保障型向技术推动型转变。重庆股份转让中心有限责任公司净



利润同比大幅增长,进一步完善企业孵化培育体系,力助中小微企业拓宽融资渠道,新增挂牌企业 170 家,交易额、融资额等主要指标在国内区域市场中位居前列。

## 2) 主营业务分地区情况的说明

### ① 营业收入地区分布报告

单位:元 币种:人民币

地区	2016 年		2015 年		营业收入增减百分比(%)
	分支机构数量	营业收入	分支机构数量	营业收入	
北京	8	99,865,123.05	7	224,248,920.42	-55.47
广东	5	69,586,708.02	4	167,581,129.56	-58.48
江苏	6	33,398,063.07	6	45,720,208.95	-26.95
广西	2	3,820,560.82	2	2,836,350.34	34.70
山东	2	11,559,321.68	2	25,304,423.48	-54.32
山西	3	17,788,903.85	3	29,837,558.49	-40.38
陕西	2	6,315,293.28	1	6,327,761.37	-0.20
上海	4	78,287,675.65	3	203,292,893.00	-61.49
四川	6	42,990,754.30	5	83,367,890.14	-48.43
贵州	1	1,096,856.19	1	900,444.52	21.81
云南	4	20,649,152.97	4	45,221,982.27	-54.34
浙江	9	76,874,585.69	8	136,271,112.82	-43.59
重庆	44	508,825,445.08	42	1,156,942,427.69	-56.02
甘肃	1	12,825,084.27	1	34,501,787.68	-62.83
河北	2	13,744,680.00	2	38,387,681.57	-64.20
湖南	5	17,246,246.96	5	25,056,261.73	-31.17
福建	2	13,471,157.47	2	19,884,974.92	-32.25
湖北	2	12,107,803.94	2	14,766,476.02	-18.00
安徽	3	6,025,926.53	3	7,770,815.74	-22.45
青海	1	2,529,412.14	1	2,747,786.27	-7.95
辽宁	2	4,299,215.44	2	6,746,243.30	-36.27
天津	1	976,250.76	1	273,758.95	256.61
吉林	1	3,714,601.31	1	6,197,237.30	-40.06
内蒙古	2	6,133,737.11	2	36,538,850.83	-83.21
宁夏	2	6,086,879.58	2	7,856,383.92	-22.52
河南	5	12,250,795.44	5	15,149,199.48	-19.13
黑龙江	1	1,824,047.12	1	1,293,414.37	41.03
江西	1	1,967,826.10	1	1,618,563.67	21.58
新疆	1	213,627.39			
境外		-2,968,663.43		-6,213,587.81	
公司本部		2,548,152,549.12		6,156,370,229.17	-58.61
合计	128	3,631,659,620.90	119	8,496,799,180.16	-57.26

### ② 营业利润地区分部报告

单位:元 币种:人民币

地区	2016 年		2015 年		营业利润增减百分比(%)
	分支机	营业利润	分支机	营业利润	

	构数量		构数量		
北京	8	64,512,920.77	7	160,919,947.15	-59.91
广东	5	22,184,780.07	4	99,587,283.52	-77.72
江苏	6	13,251,023.43	6	15,496,488.40	-14.49
广西	2	-2,186,019.01	2	-993,697.64	
山东	2	3,099,099.22	2	8,861,083.29	-65.03
山西	3	6,885,991.43	3	12,720,513.80	-45.87
陕西	2	-2,800,160.04	1	-780,155.05	
上海	4	54,407,091.17	3	143,681,471.40	-62.13
四川	6	23,853,737.73	5	49,834,677.44	-52.13
贵州	1	-802,879.54	1	-2,046,003.41	
云南	4	10,073,759.62	4	29,072,243.63	-65.35
浙江	9	47,190,936.37	8	75,518,805.47	-37.51
重庆	44	394,699,034.84	42	867,643,834.92	-54.51
甘肃	1	7,579,214.26	1	22,349,264.40	-66.09
河北	2	7,364,873.24	2	17,991,860.27	-59.07
湖南	5	-171,214.11	5	2,093,237.97	-108.18
福建	2	4,192,492.30	2	4,174,218.82	0.44
湖北	2	3,139,711.20	2	3,362,865.74	-6.64
安徽	3	-1,714,198.35	3	-4,985,345.19	
青海	1	786,334.51	1	404,818.86	94.24
辽宁	2	-1,010,457.69	2	183,968.63	-649.26
天津	1	-1,481,263.58	1	-3,325,875.16	
吉林	1	-44,239.40	1	1,010,966.97	-104.38
内蒙古	2	507,469.61	2	21,756,895.86	-97.67
宁夏	2	2,060,459.55	2	1,997,066.77	3.17
河南	5	1,628,621.77	5	6,250,761.48	-73.95
黑龙江	1	-1,375,416.19	1	-2,142,229.22	
江西	1	-663,087.74	1	-1,927,240.67	
新疆	1	-845,373.99			
境外		-178,571,642.69		-90,167,568.71	
公司本部		681,843,810.74		2,827,552,772.92	-75.89
合计	128	1,157,595,409.50	119	4,266,096,932.66	-72.87

### (2) 产销量情况分析表

适用  不适用

### (3) 成本分析表

单位：元

分类别	成本构成项目	分类别情况				
		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 (%)
证券经纪业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损失	848,111,034.88	34.28	928,629,693.38	21.95	-8.67
投资银行业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损失	261,290,623.50	10.56	231,125,046.91	5.46	13.05
资产管理业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损失	44,766,988.61	1.81	70,636,459.14	1.67	-36.62

证券自营业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损失	168,450,427.82	6.81	211,747,304.74	5.01	-20.45
--------	---------------------	----------------	------	----------------	------	--------

成本分析其他情况说明

适用 不适用

#### (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

业务及管理费用详细情况请见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 66、业务及管理费”。

## 3. 研发投入

### 研发投入情况表

适用 不适用

### 情况说明

适用 不适用

## 4. 现金流

适用 不适用

报告期内，公司现金及等价物净减少额为 46.59 亿元。具体分析如下：

(1) 经营活动产生的现金净流出 106.16 亿元，主要流入项目为：收取利息、手续费及佣金的现金 51.75 亿元，融出资金净减少额 20.70 亿元，收到其他与经营活动有关的现金净额 8.14 亿元；主要流出项目为：支付利息、手续费及佣金的现金 11.39 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 21.96 亿元，买入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 51.50 亿元，代理买卖证券支付的现金净额 57.73 亿元，支付的各项税费 7.07 亿元，拆入资金净减少额 8.85 亿元，回购业务资金净减少额 21.26 亿元，支付的其他与经营活动有关的现金 6.98 亿元。

(2) 投资活动产生的现金净流出 3.64 亿元，主要流入项目为：收回投资收到的现金 7.13 亿元，取得投资收益收到的现金 4.89 亿元；主要流出项目为：投资支付现金 13.33 亿元，购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 2.35 亿元。

(3) 筹资活动产生的现金净流入 62.66 亿元，主要流入项目为：吸收投资收到的现金 1.03 亿元，公司发行债券收到现金 180.68 亿元，收到其他与筹资活动有关的现金 17.43 亿元；主要流出项目为：偿还债务支付的现金 120.00 亿元，分配股利、利润或偿付利息支付的现金 16.48 亿元。

## (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
货币资金	18,127,955,171.10	25.53	22,205,059,526.75	30.95	-18.36	两市交易量萎缩，客户资金显著减少
结算备付金	3,592,111,154.87	5.06	4,373,744,276.33	6.10	-17.87	公司自有备付金减少
融出资金	8,041,862,035.04	11.33	10,108,587,709.91	14.09	-20.45	两融规模减少所致
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,534,339,752.67	30.33	16,376,728,884.07	22.82	31.49	本期并表结构化主体增加
买入返售金融资产	2,945,409,505.66	4.15	1,323,333,999.84	1.84	122.57	本期股票质押式回购规模增加
应收利息	538,898,651.77	0.76	414,863,179.56	0.58	29.90	本期债券投资利息增加
存出保证金	625,158,757.97	0.88	998,317,476.91	1.39	-37.38	本期交易保证金减少
可供出售金融资产	11,632,792,839.82	16.38	10,169,611,118.09	14.17	14.39	本期证券公司资管产品和银行理财产品投资增加
在建工程	285,779,102.36	0.40	240,736,919.65	0.34	18.71	公司江北嘴大楼投资增加
递延所得税资产	162,122,654.79	0.23	230,651,648.28	0.32	-29.71	本期应付职工薪酬产生的可抵扣暂时性差异减少
其他资产	733,221,648.33	1.03	1,583,697,811.77	2.21	-53.70	项目到期
应付短期融资款	7,368,400,000.00	10.38	1,300,000,000.00	1.81	466.80	发行短期公司债所致
拆入资金			885,000,000.00	1.23	-100.00	归还到期转融通融入款项
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	5,490,490,745.17	7.73	3,772,653,089.25	5.26	45.53	本期并表结构化主体增加
代理买卖证券款	13,292,127,523.64	18.72	19,064,859,186.98	26.57	-30.28	客户交易结算资金减少
应付职工薪酬	1,000,181,468.37	1.41	1,476,768,598.06	2.06	-32.27	本期计提职工薪酬减少
应付款项	139,615,260.36	0.20	656,112,350.76	0.91	-78.72	期末应付清算款减少
预计负债	64,180,032.69	0.09				预计诉讼赔偿支出
应付债券	13,447,553,351.21	18.94	12,714,977,017.90	17.72	5.76	本期发行长期次级债所致
递延所得税负债	8,239,428.84	0.01	153,414,050.84	0.21	-94.63	计入其他综合收益的可供出售金融资产公允价值变动所致
其他负债	155,743,389.49	0.22	877,714,897.42	1.22	-82.26	项目到期

**其他说明**
**(1) 资产情况**

报告期末，公司资产总额为 710.00 亿元，较上期末下降 1.04%。其中，货币资金与结算备付金共 217.20 亿元，占总资产的比重为 30.59%，较上期末减少 18.28%；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产与可供出售金融资产共 331.67 亿元，占总资产的比重为 46.71%，较上期末增加 24.94%，主要为债券投资增加；融出资金为 80.42 亿元，占总资产的比重为 11.33%，较上期末减少 20.45%；买入返售金融资产期末余额为 29.45 亿元，占总资产的比重为 4.15%，较上期末增长 122.57%，主要为股票质押式回购增加较多；长期股权投资期末余额为 16.22 亿元，占总资产的比重为 2.28%，同比减少 2.01%。从资产流动性来

看，公司流动资产为 556.09 亿元，占总资产的比重为 78.32%，说明公司资产流动性充足，同时公司对存在减值迹象的资产计提了减值准备，公司资产质量较高。

## (2) 负债情况

截至 2016 年 12 月 31 日，公司负债总额为 513.32 亿元，较上期末下降 1.59%。其中，应付短期融资款与应付债券共 208.16 亿元，占负债总额的比重为 40.55%，较上期末增长 48.53%，主要系当期发行了较多短期公司债和次级债；代理买卖证券款为 132.92 亿元，占负债总额的比重为 25.89%，较上期末减少 30.28%，主要为两市成交量萎缩，客户交易结算金减少；卖出回购金融资产款为 96.81 亿元，占负债总额的比重为 18.86%，较上期末减少 6.30%；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债为 54.90 亿元，占负债总额的比重为 10.70%，较上期末增长 45.53%，主要系合并的结构化主体增多。扣除代理买卖证券款后，公司自有负债总额为 380.40 亿元，资产负债率为 65.92%，且在报告期内，公司无到期未偿还的债务，经营状况良好，长短期偿债能力俱佳。

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项 目	期末账面价值	受限原因
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6,777,416,976.00	用作卖出回购金融资产抵押物
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	87,691,624.13	停牌或暂停交易
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	201,079,152.76	限售股
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,836,229.21	融出证券
可供出售金融资产	71,058,370.00	用作卖出回购金融资产抵押物
可供出售金融资产	468,750.00	停牌或暂停交易
可供出售金融资产	830,154,504.21	限售股
融出资金	3,105,930,934.23	用作卖出回购金融资产抵押物
合 计	11,075,636,540.54	

## 3. 其他说明

适用  不适用

### (四) 行业经营性信息分析

适用  不适用

具体参见“第三节 公司业务概要”及本节“一、经营情况讨论与分析”相关内容。

### (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，公司长期股权投资为 16.22 亿元，较年初减少 0.33 亿元，降幅 2.01%。具体内容详见该年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 17、长期股权投资以及八、母公司财务报表项目注释 2、长期股权投资”。

### (1) 重大的股权投资

适用  不适用

### (2) 重大的非股权投资

适用  不适用

报告期内，公司重大的非股权投资主要为江北嘴大楼（在建工程）项目，全年新增投资额 45,042,182.71 元，累计投资额 285,779,102.36 元，工程累计投入占预算比例 25.29%。

### (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

项目	投资成本	账面价值	报告期内购入或出售净额	公允价值变动	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	21,522,212,784.22	21,534,339,752.67	5,157,610,868.60	-219,084,860.65	767,791,273.19
可供出售金融资产	10,960,394,298.16	10,876,585,466.99	1,369,543,453.54		383,473,100.38
衍生金融工具		-174,215,314.41		-10,107,684.37	20,898,532.02
合计	32,482,607,082.38	32,236,709,905.25	6,527,154,322.14	-229,192,545.02	1,172,162,905.59

### (六) 重大资产和股权出售

适用  不适用

报告期内，子公司重庆股份转让中心有限责任公司出售重庆金融资产交易所股权，实现投资收益 6,716.46 万元。

### (七) 主要控股参股公司分析

适用  不适用

#### 1. 西证股权投资有限公司

西证股权投资有限公司系公司全资子公司，成立于 2010 年 3 月，注册资本 8 亿元人民币，注册地重庆，法定代表人王汐艾，经营范围为股权投资。西证投资还通过旗下西证重庆股权投资基金管理有限公司在股权投资管理、股权投资咨询、发起设立股权投资企业等经营范围内开展业务；通过旗下重庆西证电子商务有限责任公司利用互联网，开展商务信息咨询、经济信息咨询、计算机软件的技术开发、会议及展览服务、计算机系统服务等业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，西证投资总资产 141,321.29 万元，净资产 140,013.26 万元；报告期内实现营业收入 3,135.27 万元，亏损 2,225.33 万元。

#### 2. 西证创新投资有限公司

西证创新投资有限公司系公司全资子公司，成立于 2013 年 4 月，注册资本 40 亿元人民币，注册地重庆，法定代表人黄青山，经营范围为从事投资业务及相关资产管理；投资咨询服务；企业财务顾问服务。西证创新具备私募投资基金管理人资格，可以开展股权投资基金、证券投资基金以及创业投资基金业务。西证创新还通过下属的重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司从事股权投资管理业务；并与西证国际共同出资设立重庆西证小额贷款有限公司，在重庆市主城九区从事办理各项贷款、票据贴现、资产转让业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，西证创新总资产 240,168.68 万元，净资产 231,065.60 万元；报告期内实现营业收入 12,546.23 万元，净利润 2,149.17 万元。

### 3. 西南期货有限公司

西南期货有限公司于 2013 年 10 月成为公司全资子公司，注册资本 5 亿元人民币，注册地重庆，法定代表人李星光，经营范围为商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。西南期货有限公司还于 2017 年 2 月全资设立了期货风险管理子公司——重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司，面向客户提供风险管理服务。

截至 2016 年 12 月 31 日，西南期货总资产 163,461.14 万元，净资产 51,424.07 万元；报告期内实现营业收入 4,558.64 万元、净利润 1,094.11 万元。

### 4. 西证国际投资有限公司

西证国际投资有限公司系公司在香港特别行政区注册设立的全资子公司，成立于 2013 年 11 月，资本金 10 亿元港币，注册地香港，董事长吴坚。

2015 年 1 月，以西证国际为主体收购香港主板上市券商敦沛金融控股有限公司的工作完成，并将其正式更名为西证国际证券，其旗下全资子公司持有香港证监会核发的第 1 类（证券交易）、第 2 类（期货合约交易）、第 4 类（就证券提供意见）、第 6 类（就机构融资提供意见）、第 9 类（提供资产管理）业务牌照。

截至 2016 年 12 月 31 日，西证国际总资产 239,870.97 万元，净资产 69,072.99 万元；实现营业收入-296.87 万元，亏损 17,834.65 万元。

### 5. 重庆股份转让中心有限责任公司

重庆股份转让中心有限责任公司系公司控股子公司，公司持有 53% 股权，公司于 2013 年 2 月成为其控股股东。重庆股份转让中心注册资本 15,625 万元人民币，注册地重庆，董事长吴坚，经营范围包括为非上市股份公司股份、有限公司股权以及其他各类权益的登记、托管、挂牌、交易、结算及投融资提供场所和服务。

截至 2016 年 12 月 31 日，重庆股份转让中心总资产 65,208.86 万元，净资产 25,389.95 万元；实现营业收入 12,669.39 万元，净利润 7,249.18 万元。

### 6. 银华基金管理股份有限公司

银华基金管理股份有限公司，公司持有 49% 股权，为其第一大股东。银华基金成立于 2001 年 5 月，于 2016 年 8 月整体变更为股份有限公司，现注册资本 2 亿元人民币，注册地深圳，

法定代表人王珠林，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，银华基金总资产 253,777.86 万元，净资产 179,717.77 万元；报告期内实现营业收入 160,981.12 万元，营业利润 44,362.23 万元，净利润 32,626.05 万元。

#### (八) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

公司根据《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》(2014)，对于公司管理并投资的结构化主体（如：资产管理计划、基金），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公司对结构化主体拥有控制权。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。

本期末，公司及子公司作为资产管理计划管理人并投资西南证券双喜汇鑫 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫 4 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫 6 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债中银 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉 4 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉策略 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉混合配置集合资产管理计划、西南证券双喜基金优选 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫光大 1 号集合资产管理计划、西南证券新三板鑫瑞 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫工银 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉策略 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫工银 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉混合配置 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划、西南证券益乾 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划、西南证券双喜聚金 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉混合配置 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫策略 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉混合配置 4 号集合资产管理计划、西南证券双喜长安 1 号集合资产管理计划、西南证券盛誉定增策略 1 号集合资产管理计划、西南证券盛誉瑞泽策略 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫策略 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇鑫策略 1 号集合资产管理计划、西南证券益乾 1 号集合资产管理计划、西南证券益乾 2 号集合资产管理计划、西南证券珠峰 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜汇智 4 号集合资产管理计划、西南期货 CTA 量化 3 号资产管理计划、西南期货余粮套利对冲 1 号资产管理计划、西南多策略优选 1 号资产管理计划、西南期货 CTA 量化 1 号资产管理计划、西南期货胜拓 1 号资产管理计划、西南期货双子星 1 号资产管理计划、西南炫霆 2 号资产管理计划等 41 只集合资产管理计划，并对其实施控制，故将其纳入公司合并财务报表的合并范围。



本期末,公司及子公司作为合伙企业的普通合伙人投资重庆西证阳光股权投资基金合伙企业(有限合伙)、重庆西证价值股权投资基金合伙企业(有限合伙)、重庆西证渝富肆号城市发展股权投资基金合伙企业(有限合伙)、重庆西证渝富叁号城市发展股权投资基金合伙企业(有限合伙)、新疆西证创新股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆西证丝路股权投资合伙企业(有限合伙)、珠海西证汇盈股权投资基金合伙企业(有限合伙)、嘉兴渝信投资合伙企业(有限合伙)、西证创投定增壹号证券投资基金、西证创盈 1 号另类策略私募基金、重庆拓景一号私募投资基金、西证渝富渝江四号私募证券投资基金和西证渝富渝江五号私募证券投资基金,并对其实施控制,故将其纳入公司合并财务报表的合并范围。

### 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 年经济开局良好,延续稳中向好的基本态势,金融服务实体经济、发展多层次资本市场、提高直接融资比重等内容列入十三五规划纲要,将进一步激发资本市场的资源配置功能和支持实体经济融资功能,其在国民经济发展中的重要性日益凸显。证券行业基本面深刻变化,新的增长动能正在孕育形成,严控资本市场风险和促进资本市场服务实体经济有望继续成为监管层的关注重点。随着多层次资本市场体系不断健全,特别是股市恢复市场融资功能、并购重组市场化改革、新三板分层制度落地、区域性股权市场规范发展、股指期货开始松绑、以养老基金为代表的长期资金入市,以及深港通、沪港通、QFII 等双向交易、双向流动通道的逐渐打通等,将全面打开证券行业新一轮的发展空间和想象空间。证券行业正本清源,防风险仍将是监管的主基调,依法、从严、全面监管政策将进一步落地。伴随行业创新不断深入和券商资产负债规模持续扩大,券商已迈入全面风险管理时代,合规风控能力成为券商又一核心竞争力。互联网金融作为新兴的金融业态,依托先进的互联网技术,对传统金融行业带来了由点到面、由浅到深的影响,一定程度上改变了证券业总体面貌与竞争格局,持续冲击着券商的传统经营理念、商业模式和运营模式。证券行业的竞争分化与风口争夺将进一步升级,逐步从同质化转向差异化。

#### (二)公司发展战略

适用 不适用

公司始终坚持以客户为中心的经营宗旨,以服务实体经济为重要导向,以回报股东和社会为己任,将紧抓国内供给侧结构性改革深化和创新驱动战略深入推进的历史契机,把握一带一路、西部大开发、长江经济带发展等重要战略机会,主动适应行业监管和环境变化,加强全牌照业务布局,推动业务创新和内外资源整合,提升合规风控能力,努力构建全牌照、一体化、跨地域、多功能的综合金融服务模式,尽快迈入一流证券公司行列,尽快打造成为重庆和西部金融业的标杆企业。

### (三) 经营计划

√适用 □不适用

2017 年，公司将紧紧抓住外部机遇和行业调整的窗口期，深入推进市场化改革，全面整合内外部资源，不断夯实经营基础，严控经营管理风险，增收节支、开源节流，稳健经营、稳中求进，持续优化盈利模式和发展质量，竭力培育比较优势和核心竞争力；同时积极布局创新业务，做大做强优势业务，补足补齐发展短板，拓展金融服务内涵，增强业务发展的协调性、均衡性和可持续性，有效开辟新的利润增长点，巩固提升公司市场份额和行业地位。

### (四) 可能面对的风险

√适用 □不适用

#### 1. 面对的主要风险

报告期内，公司面临的主要风险包括：流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险以及创新业务风险，主要表现在以下几个方面：

##### (1) 流动性风险

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

公司的流动性风险主要包括资产流动性风险和负债流动性风险。资产流动性风险是指公司所持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损失的可能；负债流动性风险是指由于公司缺乏现金，不能维持正常的业务支出或不能按时偿还债务，以及流动资金不足以应对客户大规模赎回公司管理产品的风险。此外，投资银行业务大额包销、自营业务投资规模过大、期限不匹配、长期资产比例过高等因素，都可能导致公司资金周转不畅，出现流动性困难的状况。

##### (2) 市场风险

市场风险是目前证券公司面临的最主要风险之一，是指所持金融工具的公允价值因市场价格不利变动而发生的损失，包括股票、基金及衍生品等权益类证券价格风险、利率风险、汇率风险等。

当投资的股票、基金、股指期货、组合投资等权益类品种及权益类衍生品，在缺乏有效的对冲机制情景下，面对市场价格或波动率变化时，可能产生价格风险。当投资债券等固定收益类证券面对利率、收益率曲线变化时，可能产生利率风险。外汇汇率的变化，将可能发生汇率风险。报告期内，A 股市场仍发生较大波动，公司自营业务部门及自有资金参与资管计划开展证券投资承担一定市场风险，所持金融资产公允价值波动较大，公司采用风险价值（VaR）为主要工具定量分析各业务单元及公司整体市场风险。

##### (3) 信用风险

信用风险是指公司的交易对手或公司持有证券的发行人无法履行合同义务的情况下给公司造成损失的风险,以及公司持有证券的发行人信用状况发生恶化情况下给公司造成损失的风险。

公司面临的信用风险主要来自两个方面:一是融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购等业务的信用风险,即由于客户未能履行合同约定而给公司带来损失的风险;二是债券类投资的违约风险,即所投资债券的发行人或交易对手出现违约、拒绝支付到期本息,导致资产损失或收益变化的风险。随着公司信用业务的发展及市场震荡加剧,融资类业务容易受市场风险影响从而诱发信用风险,如发生违约风险事件,信用风险暴露,可能对公司造成一定损失。

#### (4) 操作风险

操作风险,指由于人员、内部程序、系统的不完善或失误,以及企业外部事件冲击给公司带来损失的风险。

公司操作风险主要包括四个方面:

①人员风险,指公司员工内部欺诈、失职违规、知识/技术匮乏、核心人员流失等造成损失的风险;

②内部流程风险,指在日常业务开展过程中财务/会计错误、文件/合同缺陷、产品设计缺陷、错误监控/报告、计算/支付错误和交易/定价错误导致公司损失的风险;

③技术风险,是指数据/信息系统缺陷、系统设计和开发错误或系统稳定性与兼容性不够完善造成的损失风险;

④外部风险,是指业务开展过程中外部人员和机构欺诈、监管规定的变化和政治因素导致损失的风险。

#### (5) 创新业务风险

公司报告期内开展了股权激励行权融资业务、港股通等创新业务,并积极探索互联网证券业务。创新业务的快速发展在丰富金融产品的同时也产生了新的风险管理需求。在各项创新业务开展中,依然会面对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等,特别是流动性风险和操作风险,对于创新业务来说,由于规模体量的限制,相对缺乏可以随时变现的市场环境,流动性风险更为突出;其次,对于某些创新产品复杂的定价过程和支付过程,导致存在较大操作风险。因此,对创新型业务的合规性判断、产品开发、风险识别和风险定价能力提出更高的要求,如对此类创新业务的风险点认识不全、对其风险大小估计不足、风险控制机制不健全或执行不到位等,都可能会导致面临风险。

## 2. 已采取或拟采取的对策

报告期内,公司从风险管理组织、制度、系统、指标、人员及应对处置等六个方面加强全面风险管理体系建设,健全公司风险管理组织架构,完善风险管理制度,建立风险管理信息系统,强化各业务风险的识别与控制,针对净资本和流动性风控指标、市场风险、信用风

险、流动性风险实行重点管理，建立起适应公司经营水平和业务规模的风险管理制度体系，确保各项业务在运营过程中的风险可测、可控、可承受。

(1) 公司建立起由董事会、投资决策委员会及自营业务部门组成的投资业务三级决策与授权体系，对自有资金投资实行授权管理；同时，公司任命一名高级管理人员为首席风险官，负责全面风险管理工作，并设立独立的风险管理部门对市场风险进行评估、监测和报告，确保公司整体市场风险水平在适当的范围之内。

公司采取风险限额措施对各业务单元所承担的市场风险进行控制，风险限额主要包括规模限额、止损限额、集中度限额等。董事会确定自营业务年度规模和最大可承受风险限额；投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；自营业务部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、止损线等进行前端控制；风险管理部门进行实时监控，及时进行风险提示，督促自营业务部门进行风险处置。报告期内，公司加强对权益和非权益类投资业务的风险管理，进一步加强盘中、盘后监控力度，每日监测投资盈亏、风险敞口和授权指标等内容。

此外，公司建立压力测试机制，对极端情景下公司可能面临的市场风险进行分析。极端情景主要包括：宏观经济衰退、证券市场价格及利率大幅不利变动、特殊风险事件等。通过压力测试评估公司自有资金投资在极端情况下的可能损失金额，判断公司整体的市场风险是否在可承受范围之内，并拟定应对措施。

(2) 融资融券、约定购回、股票质押回购业务的信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物涉及法律纠纷等。公司主要通过对客户进行风险准入、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、加强项目尽职调查及后续管理、司法追索等手段，来对融资类业务的信用风险进行管理。报告期内，公司对场内开展的信用交易业务已建立交易对手的征信授信评估流程，对信用风险资产建立监控系统。公司将继续完善信用评级指标和模型、客户及项目选择准入标准、风险评估报告模式等信用风险管理体系。

对债券投资的信用风险管理，主要借助风险限额、信用评级等手段，以信用风险限额和内部评级为基础，从投资品种、发行主体和交易对手三个维度分类分级授权。其中，限额管理涵盖持仓限额和交易限额两大类。持仓限额包括组合信用风险值、交易对手信用风险敞口、信用债券集中度、低评级信用债持仓占比等指标；交易限额包括低评级债券交易限额和交易对手结算风险限额；结算风险限额针对不同类别的交易对手，采用不同的交易结算方式，并设定不同的授权额度。所有超过交易额度授权的业务均需报上一级授权组织批准。交易对手内部信用评级管理体系包括交易对手内部信用评级、交易对手信用风险敞口计量、交易对手信用风险压力测试等。

(3) 公司制定了《西南证券股份有限公司流动性风险管理办法》，明确公司流动性风险管理的目标、原则、组织体系和工作方法，提出从流动性限额、融资策略、现金流缺口、日

间流动性管理、优质流动性资产配置、压力测试、应急计划等方面加强流动性管理，增强应对流动性冲击的能力。

报告期内，公司坚持资金营运安全性、流动性与效益性相统一的经营原则，强调资金的集中统一管理和运用，资金拆借、回购等业务由资金部门集中管理，确保了资金流动性充足；随着公司两融资产回笼，公司现金及等价物在总资产中的比重有所上升，资产结构出现较大变化，资产变现能力整体提升。跟随行业去杠杆的整体趋势，公司负债规模同比有所下降。流动性风险控制指标流动性覆盖率（LCR）、净稳定资金率（NSFR）持续符合监管标准。

(4) 公司制订了《西南证券股份有限公司操作风险管理办法》，明确公司操作风险管理的目标、原则、组织体系和工作方法，提出从内控机制、风险监测、风险缓释、风险管理工具、风险报告和风险应急管理应急预案等方面加强操作风险管理。公司还对质押式融资回购业务、股票期权业务、互联网金融业务、港股通等业务制定了风险监控作业指导书和风险管理办法，确保公司各个业务环节标准化，流程化，尽可能降低操作风险事件发生的可能性。

通过构建操作风险分级监控体系，公司各业务部门和分支机构设立了合规风控经理对部门内部操作风险进行前端监控，对风险较大的业务设专人专岗进行盯市，对关键业务数据双人进行复核。风险管理部门进行独立监控，通过内控平台、债券本币交易系统分别对交易所市场和银行间市场操作风险进行监控。

(5) 公司在充分考虑自身实际情况，资本实力、经营能力、专业水平、风险管理能力、合规管理、团队建设、技术条件满足创新业务需要的前提下开展创新业务。同时，将创新业务纳入公司全面风险管理体系，所有创新业务方案先由风险管理部门独立评估，建立风险监控和预警机制，制定应急处理预案，对创新风险做到准确识别、实时监测，把创新业务的风险敞口控制在公司净资本和流动性水平可承受的范围之内。公司通过加强对创新业务的研究，完善创新业务管理体系，认真评估公司风险承受能力，审慎确定各项创新业务风险容忍度，合理进行创新业务规模授权，从适当的规模授权进行试点，运作相对成熟后逐步加大授权，在有效控制风险前提下促进创新业务正常开展。此外，公司在风险收益基础上，引入经济资本等绩效指标，更好地匹配投资风险与收益关系，提高风险资源使用效率，降低各项风险对公司的影响。

### 3. 公司风险控制指标动态监控和补足机制

公司根据修订后《证券公司风险控制指标管理办法》完善修订公司《净资本与风险控制指标管理办法》，对净资本和流动性风控指标的计算规则、方法和流程予以明确，通过建立净资本与风险控制指标监控系统，实施净资本与风险控制指标的动态监控和自动预警机制，实现动态显示和监控。

#### (五) 其他

适用  不适用

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

报告期内，公司继续严格执行公司章程中关于现金分红比例等相关规定，未对现金分红政策进行调整。公司 2015 年度利润分配方案由独立董事发表意见并经股东大会审批通过后实施，充分保护了中小投资者的合法权益。

#### (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	1.00	0	564,510,912.40	917,572,729.00	61.52
2015 年	0	1.30	0	733,864,186.12	3,554,650,541.89	20.65
2015 年中期	0	1.20	10	338,706,547.44	3,554,650,541.89	9.53
2014 年	0	1.80	0	508,059,821.16	1,339,048,940.41	37.94

#### (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
与再融资相关的承诺	股份限售	重庆城投、江北嘴集团、重庆高速、重庆水务资产	所认购的公司 2013 年非公开发行之 5 亿股股票,限售期限为 36 个月,预计可上市流通时间为 2017 年 2 月 24 日(如遇非交易日则顺延到交易日);对应取得的公司 2015 年半年度资本公积金转增股本的 5 亿股股票一并限售。	2014 年 2 月至 2017 年 2 月	是	是
其他对公司中小股东所作承诺	其他	重庆渝富、重庆城投	在符合相关法规及规范性文件条件下,通过包括但不限于证券公司、基金管理公司定向资产管理等方式增持公司股份(其中,重庆渝富投入增持资金不低于人民币 8.724 亿元,重庆城投投入增持资金不低于 24,414.57 万元)。	2015 年 7 月承诺,至本报告期内均已按计划实施完毕。	否	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	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	110
境内会计师事务所审计年限	4

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	40

#### 聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用  不适用

公司 2016 年第三次临时股东大会审议通过《关于聘请公司 2016 年度审计及内部控制审计中介机构的议案》，同意聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2016 年度审计及内部控制审计中介机构，审计费用分别为 110 万元、40 万元，均含异地差旅费。

#### 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

**(三) 公司本年度被处罚和公开谴责的情况**

适用  不适用

**1. 公司收到中国证监会调查通知书**

2016年6月23日，公司收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字2016975号），内容为：“因你公司涉嫌未按规定履行职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

2017年3月17日，公司收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字2017194号），内容为：“因你公司在从事上市公司并购重组财务顾问业务活动中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，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

有关内容及影响详见2016年6月24日、2017年3月18日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《关于收到〈中国证券监督管理委员会调查通知书〉及复牌的公告》、《关于收到〈中国证券监督管理委员会调查通知书〉的公告》。

**2. 公司证券自营业务风险控制指标合规整改完成**

因公司约定购回式证券交易业务被动持有江苏中泰桥梁钢构股份有限公司股票以及自营业务通过二级市场交易持有该股票之合达到其总股本5.03%，致使公司证券自营业务风险控制指标出现不符合《证券公司风险控制指标管理办法》规定的情况。报告期内，公司已按要求完成整改工作，相关指标已符合规定。

有关内容详见2016年6月24日、7月22日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《关于证券自营业务风险控制指标情况及收到重庆证监局行政监管措施决定书的公告》、《关于证券自营业务风险控制指标合规整改完成情况的公告》。

#### (四)其他说明

√适用 □不适用

##### 1. 公司申请执行蔡开坚股票质押式回购交易纠纷案

重庆仲裁委员会于 2015 年 1 月 20 日作出 (2014) 渝仲字第 1071 号裁决书, 裁决被申请人蔡开坚应向公司偿还本金人民币 11,700 万元以及相关利息、违约金等。现公司已向浙江台州市中级人民法院申请强制执行, 以实现蔡开坚质押给公司的 3,700 万股“中捷股份 (代码 002021)”的优先受偿权。该案, 因蔡开坚涉及其他诉讼案件, 其质押股票被浙江省高级人民法院冻结, 现执行法院台州市中级人民法院正与浙江省高级人民法院积极沟通, 推进该案执行。公司对蔡开坚的债权享有优先受偿权, 通过必要的法律程序, 能够保障公司的合法权益。

##### 2. 公司申请执行铜陵市三佳电子 (集团) 有限责任公司、上海中发电气 (集团) 股份有限公司、陈邓华股票质押式回购交易纠纷案

公司于 2014 年 12 月 24 日向重庆仲裁委员会申请仲裁, 该案涉及本金人民币 14,000 万元以及相关利息、违约金等。2016 年 5 月 27 日, 铜陵市三佳电子 (集团) 有限责任公司与我公司达成《还款和解协议》; 2016 年 5 月 30 日, 铜陵市三佳电子 (集团) 有限责任公司偿还全部本金、利息以及违约金和仲裁费、律师费。公司向重庆仲裁委员会申请撤回仲裁申请, 重庆仲裁委员会于 2016 年 7 月 1 日做出决定同意撤回仲裁申请。该案件已结案。

##### 3. 新华证券有限公司诉公司股票交易纠纷案

2015 年 10 月, 新华证券有限公司破产管理人向吉林省长春市中级人民法院提起诉讼, 请求法院判令公司上海陆家嘴东路证券营业部 (原公司上海定西路证券营业部) 因 2003 年抛售原告股票向其赔偿损失及承担利息, 并要求公司承担连带责任。2016 年 9 月 30 日, 公司收到该案民事判决书, 法院判令公司上海陆家嘴东路证券营业部给付新华证券有限公司抛售股票所得款及账户余额 19,137,895.2 元, 支付原告抛售股票损失款 15,469,889.5 元, 并给付原告利息损失, 判决公司与公司上海陆家嘴东路证券营业部共同对上述债务承担给付责任。公司及公司上海陆家嘴东路证券营业部对该判决不服, 已于 2016 年 10 月 14 日向吉林省高级人民法院提起上诉。2017 年 3 月 1 日, 吉林省高级人民法院作出了驳回上诉, 维持原判的终审判决。2017 年 3 月 17 日, 公司依据生效判决向新华证券支付款项 64,535,442.42 元。该案件已履行完毕。

##### 4. 西证创新投资有限公司诉渝宏公路工程 (集团) 有限公司、重庆市交通融资担保有限公司债券合同纠纷案

西证创新投资有限公司于 2015 年 11 月向重庆市第五中级人民法院提起诉讼, 请求法院判令渝宏公路工程 (集团) 有限公司偿还债券本金 5,000 万元及利息以及原告实现债权的费用, 判令重庆市交通融资担保有限公司承担连带清偿责任。重庆市第五中级人民法院于 2016

年 4 月 12 日作出一审判决，支持了西证创新投资有限公司全部诉讼请求。针对上述判决，被告重庆市交通融资担保有限公司不服，向重庆市高级人民法院提起上诉。2016 年 10 月 9 日，重庆市高级人民法院做出驳回上诉，维持原判的终审判决，现重庆市交通融资担保有限公司已依据生效判决全部履行完毕。

#### 5. 重庆西证小额贷款有限公司申请执行张抛贫、邓祖兰抵押借款合同纠纷案

重庆西证小额贷款有限公司于 2015 年 8 月向江北区人民法院提起诉讼，请求法院判令被告张抛贫偿还欠款本金 1,170 万元并承担利息及实现债权的费用，判令被告邓祖兰承担连带清偿责任。该案于 2016 年 5 月进入执行程序，现已收回本金 20 万元。

#### 6. 重庆西证小额贷款有限公司诉邓刚、邓丽娟等六保证人保证合同纠纷案

2016 年 7 月 1 日，重庆西证小额贷款有限公司向重庆市渝北区人民法院提起诉讼，请求法院判令邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆鑫林科技发展有限公司六保证人连带支付重庆公信科技发展（集团）有限公司所欠西证小贷的借款本金 1000 万元、利息、罚息及复利。2016 年 9 月 30 日，渝北区人民法院一审判决邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆鑫林科技发展有限公司等六位保证人对本笔贷款的本金、利息、复利及罚息承担连带清偿责任。该案于 2016 年 12 月进入执行阶段。2017 年 1 月，重庆公信科技发展（集团）有限公司按重整方案对确认债权进行还款，现已收回本金 4.25 万元。2017 年 3 月，就邓刚、邓丽娟、邓苏轩所持四川广安建设集团有限公司等七公司债权，重庆西证小额贷款有限公司已通过重庆市渝北区人民法院向四川省广安市广安区人民法院申请参与分配；就吴开平、重庆鑫林科技发展有限公司所持四川广安建设集团有限公司等七公司债权，重庆市渝北区人民法院已要求四川广安建设集团有限公司等七公司管理人将上述债权受偿额扣划至重庆西证小额贷款有限公司。

### 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

报告期内，公司及公司控股股东不存在未履行法院生效判决、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

###### 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

公司放弃对重庆渝富所转让重庆 OTC 股权之优先认购权。报告期内，重庆渝富基于其体系内部整合的需要，将其所持重庆 OTC（公司控股子公司）之 32% 股权转让予其全资股东重庆渝富控股集团有限公司。重庆 OTC 截至 2015 年末经审计净资产约合 1.86 亿元，本次转让的 32% 股权所对应净资产金额约合 0.60 亿元。上述股权转让本质上不属于重庆渝富对外转让重庆 OTC 股权或者重庆 OTC 引入新的投资者，从利于重庆 OTC 后续平稳健康发展等综合考虑，经公司董事会关联交易决策委员会会议审议同意，公司不行使对上述所转让股权的优先认购权。上述股权转让后，公司所持重庆 OTC 股权比例不变，仍为其控股股东，并继续合并其财务报表。

公司其它日常关联交易等事项详见本报告第十一节财务报告附注中有关内容。

**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、其他重大事项的说明** 适用  不适用

### (一) 取得业务资格情况

1. 2016 年 4 月，公司收到深圳证券交易所《关于同意西南证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函》（深证函[2016]279 号），同意公司开展上市公司股权激励行权融资业务试点。

2. 2016 年 11 月，公司收到深圳证券交易所《关于同意开通财达证券等会员单位深港通下港股通业务交易权限的通知》（深证会[2016]330 号），同意开通公司相关交易单元的深港通下港股通业务交易权限。

有关内容详见 2016 年 4 月 19 日、11 月 9 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《关于获批上市公司股权激励行权融资业务试点的公告》、《关于获准开通深港通下港股通业务交易权限的公告》。

### (二) 相关大股东完成增持公司股份事项

报告期内，根据大股东重庆渝富、重庆城投的来函，重庆渝富至 2016 年 5 月通过专项资产管理计划，增持公司股份约合 1.07 亿股，投入金额约合 8.73 亿元；重庆城投至 2016 年 12 月末通过定向资产管理计划，增持公司股份约合 0.34 亿股，投入金额约合 2.48 亿元。至此，上述大股东于 2015 年 7 月所作出之增持公司股份的安排均已按计划完成。

有关内容详见 2016 年 3 月 16 日、3 月 18 日、5 月 12 日，2017 年 1 月 4 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《关于公司股东增持公司股份的进展公告》、《关于公司股东增持公司股份的结果公告》。

### (三) 实施 2015 年度利润分配

2016 年 5 月 18 日，公司披露了《2015 年度利润分配实施公告》，相应红利已于 2016 年 5 月 25 日实施发放。

有关内容详见 2016 年 5 月 18 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《2015 年度利润分配实施公告》。

### (四) 董、监事及高级管理人员变动情况

1. 经中国证监会重庆监管局《关于核准廖庆轩证券公司董事长类人员任职资格的批复》（渝证监许可[2016]1 号）核准，廖庆轩先生自 2016 年 7 月 15 日起正式任职公司董事长。

2. 报告期内，崔坚先生辞去公司第七届董事会董事长、董事会战略委员会主任委员、董事职务；余维佳先生辞去公司总裁、第七届董事会战略委员会委员、风险控制委员会主任委员及董事职务。

3. 报告期内，公司董事会聘任吴坚先生为公司总裁，自 2016 年 7 月 18 日起正式任职；公司股东大会决议同意增补吴坚先生为第七届董事会董事，自 2016 年 8 月 3 日起正式任职，根据董事会决议，自该日起吴坚先生还担任公司第七届董事会风险控制委员会主任委员、战略委员会委员。

4. 董事会换届

经公司 2017 年 3 月 1 日第七届董事会第五十三次会议、2017 年 3 月 21 日 2017 年第一次临时股东大会及第八届董事会第一次会议审议通过，同意选举廖庆轩先生、李剑铭先生、吴坚先生、张纯勇先生、张刚先生、万树斌先生为公司第八届董事会非独立董事，赵如冰先生、罗炜先生、傅达清先生为公司第八届董事会独立董事；选举廖庆轩先生为公司第八届董事会董事长；选举产生公司第八届董事会专门委员会成员及主任委员。

#### 5. 监事会换届

经公司 2017 年 3 月 1 日第七届监事会第二十五次会议、2017 年 3 月 21 日 2017 年第一次临时股东大会及第八届监事会第一次会议审议通过，同意选举蒋辉先生、李波先生（系重庆市城市建设投资(集团)有限公司党委副书记、总经理、董事）为公司第八届监事会非职工监事；选举蒋辉先生为公司第八届监事会主席。同时，公司职工代表大会选举公司职工赵天才先生为公司第八届监事会职工监事，待其取得证券公司监事任职资格后正式任职。

有关内容详见 2016 年 7 月 16 日、7 月 19 日、8 月 4 日，2017 年 3 月 2 日、3 月 23 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《关于董事长廖庆轩先生的任职公告》、《第七届董事会第四十九次会议决议公告》、《2016 年第三次临时股东大会决议公告》、《第七届董事会第五十三次会议决议公告》、《第七届监事会第二十五次会议决议公告》、《2017 年第一次临时股东大会决议公告》、《第八届董事会第一次会议决议公告》、《第八届监事会第一次会议决议公告》。

### (五) 公司非公开发行限售股上市流通

公司经核准于 2014 年 2 月 24 日非公开发行 5 亿股 A 股，该等股份于 2015 年 9 月根据公司 2015 年中期资本公积金转增股本方案相应获转增 5 亿股 A 股，上述合计 10 亿股 A 股按规定获准于 2017 年 2 月 24 日起上市流通。

有关内容详见 2017 年 2 月 20 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《非公开发行限售股上市流通公告》。

## 十七、积极履行社会责任的工作情况

### (一) 上市公司扶贫工作情况

√适用 □不适用

#### 1. 精准扶贫规划

紧紧围绕“精准扶贫、精准脱贫”基本方略，贯彻落实《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》，发挥行业优势，精准对接贫困地区融资需求，广泛参与贫困地区经济建设，不断增强贫困地区自我发展能力。

积极履行社会责任，响应证券业协会“一司一县结对帮扶”倡议，大力支持对口贫困县经济发展，加大对贫困县扶持力度。支持慈善事业，采取多种方式开展公益扶贫，坚持回馈社会，服务国家脱贫攻坚战略。

## 2. 年度精准扶贫概要

公司与国家级贫困县重庆城口县建立结对帮扶关系，2016 年，公司向重庆城口县捐赠扶贫开发资金 350 万元。

公司投行积极参与农发债、地方政府债的承销，累计承销农发债逾 450 亿元，并在报告期内承销了规模达 4 亿元的两期扶贫专项金融债；承销宁夏地方政府债券 5,000 万元；新三板业务向贫困地区企业倾斜资源，给予费收优惠，帮助贫困地区重点企业利用资本市场做大做强，为帮豪种业提供了新三板挂牌及做市服务，成为西南地区首家登录新三板的种业公司，并在后续协助其完成 5 笔增发，共融资 8,800 余万元，助其构建产业链、补充营运资金、扩建育种研发中心，进行产品研发升级和质量优化，进一步实施企业发展战略。

2016 年，公司通过捐资助学、关爱留守儿童、社区服务、帮扶困难职工家庭等方式开展各类公益慈善活动。其中，公司通过中国证券业协会向山西省临汾市汾西县等贫困地区的贫困大学生提供帮扶资金和修建图书馆等设施，捐赠资金 19.64 万元；向四川省广安市岳池县北城乡高木桥村定点援建扶贫项目捐赠 5 万元。

## 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	374.64
二、分项投入	
1. 产业发展脱贫	
其中：1.1 产业扶贫项目类型	<input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input checked="" type="checkbox"/> 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	8
2. 教育脱贫	
其中：资助贫困学生投入金额及改善贫困地区教育资源投入金额	19.64
3. 社会扶贫	
其中：定点扶贫工作投入金额	350
4. 其他项目	
其中：4.1 项目个数（个）	1
4.2 投入金额	5

## 4. 后续精准扶贫计划

2017 年，公司将继续贯彻落实国家脱贫攻坚重要战略，继续做好对口贫困县的结对帮扶工作，发挥专业能力和资源整合优势，多渠道为贫困地区提供全方位的综合金融服务，积



极探索产业扶贫、消费扶贫和公益扶贫，持之以恒参与社会公益事业，为打赢脱贫攻坚战、实现全面建成小康社会目标贡献力量。

## (二) 社会责任工作情况

适用  不适用

报告期内，作为社会公众企业，公司积极履行社会责任，有关情况详见 2017 年 4 月 14 日公司发布于上海证券交易所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 的《西南证券股份有限公司 2016 年度社会责任报告》。

## (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

## 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

报告期内，公司普通股股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2. 普通股股份变动情况说明

适用  不适用

##### 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

##### 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

报告期内，公司大股东重庆渝富、重庆城投函告，其于报告期内分别通过资产管理计划增持公司股份约合 1.07 亿股、0.34 亿股，分别占公司总股本的 1.90%、0.6%。至此，上述股东增持公司股份的安排已全部按计划完成。

#### (二) 限售股份变动情况

适用  不适用

### 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：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(亿元)	上市日期	获准上市交易数量(亿元)	交易终止日期
可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类						
次级债券	2016-06-01	3.63%	30	2016年6月23日	30	2021-06-02
次级债券	2016-09-14	3.49%	30	2016年10月17日	30	2019-09-20
证券公司短期公司债券	2016-01-18	3.00%	15	2016年2月18日	15	2016-04-18
证券公司短期公司债券	2016-01-18	3.00%	15	2016年2月18日	15	2016-07-17
证券公司短期公司债券	2016-01-18	3.10%	15	2016年2月18日	15	2016-10-15
证券公司短期公司债券	2016-04-12	3.15%	30	2016年4月29日	30	2017-01-08
证券公司短期公司债券	2016-12-16	4.80%	40	2016年12月29日	40	2017-09-15

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

#### (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

**(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)	153,417
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	157,173

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

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (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	
重庆渝富资产经营管理集团有限公司	0	1,523,443,610	26.99	0	无	0	国有法人
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	0	400,500,000	7.09	300,000,000	质押	250,000,000	国有法人
中国建银投资有限责任公司	0	328,427,012	5.82	0	无	0	国有法人
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	0	305,400,000	5.41	300,000,000	质押	158,060,000	国有法人
重庆高速公路集团有限公司	0	300,000,000	5.31	300,000,000	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	79,314,949	150,739,823	2.67	0	无	0	未知
东吴证券股份有限公司	-42,000,082	130,000,000	2.30	0	无	0	国有法人
招商财富—招商银行—渝富4号专项资产管理计划	95,200,038	107,218,242	1.90	0	无	0	其他
重庆市水务资产经营有限公司	0	100,000,000	1.77	100,000,000	无	0	国有法人
重庆国际信托股份有限公司	0	88,738,868	1.57	0	无	0	境内非国有法人
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				
重庆渝富资产经营管理集团有限公司	1,523,443,610	人民币普通股	1,523,443,610				
中国建银投资有限责任公司	328,427,012	人民币普通股	328,427,012				
中国证券金融股份有限公司	150,739,823	人民币普通股	150,739,823				
东吴证券股份有限公司	130,000,000	人民币普通股	130,000,000				
招商财富—招商银行—渝富4号专项资产管理计划	107,218,242	人民币普通股	107,218,242				
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	100,500,000	人民币普通股	100,500,000				
重庆国际信托股份有限公司	88,738,868	人民币普通股	88,738,868				
中央汇金资产管理有限责任公司	62,392,600	人民币普通股	62,392,600				
重庆市涪陵区城乡资产管理有限公司	53,945,800	人民币普通股	53,945,800				
甘肃亚盛实业(集团)股份有限公司	42,600,000	人民币普通股	42,600,000				
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中的中国建银投资有限责任公司、中央汇金资产管理有限责任公司具有同一控股股东；重庆渝富资产经营管理集团有限公司通过招商财富—招商银行—渝富4号专项资产管理计划增持公司股份。除此之外，公司未知其他股东之间的关联关系或一致行动关系。						

**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	重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	300,000,000	2017年2月24日	300,000,000	认购公司2013年非公开发行的A股股票,限售期为36个月;对应取得的公司2015年半年度资本公积金转增股本的股票一并限售。
2	重庆市城市建设投资(集团)有限公司	300,000,000	2017年2月24日	300,000,000	认购公司2013年非公开发行的A股股票,限售期为36个月;对应取得的公司2015年半年度资本公积金转增股本的股票一并限售。
3	重庆高速公路集团有限公司	300,000,000	2017年2月24日	300,000,000	认购公司2013年非公开发行的A股股票,限售期为36个月;对应取得的公司2015年半年度资本公积金转增股本的股票一并限售。
4	重庆市水务资产经营有限公司	100,000,000	2017年2月24日	100,000,000	认购公司2013年非公开发行的A股股票,限售期为36个月;对应取得的公司2015年半年度资本公积金转增股本的股票一并限售。

### (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	重庆渝富资产经营管理集团有限公司																																															
单位负责人或法定代表人	李剑铭																																															
成立日期	2004年2月27日																																															
主要经营业务	市政府授权范围内的资产收购、处置及相关产业投资,投资咨询,财务顾问,企业重组兼并顾问及代理,企业和资产托管(国家法律法规规定须取得前置审批的,在未取得审批前不得经营)。																																															
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	<table border="1"> <thead> <tr> <th>序号</th> <th>投资上市企业</th> <th>股票代码</th> <th>总股本(万元)</th> <th>持股数(万股)</th> <th>持股比例(%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>重庆银行股份有限公司</td> <td>01963.HK</td> <td>312,700</td> <td>40,701</td> <td>13.02</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>重庆川仪自动化股份有限公司</td> <td>603100</td> <td>39,500</td> <td>5,138</td> <td>13.01</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>中房地产股份有限公司</td> <td>000736</td> <td>29,719</td> <td>3,176</td> <td>10.69</td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>重庆农村商业银行股份有限公司</td> <td>03618.HK</td> <td>930,000</td> <td>62,930</td> <td>6.77</td> </tr> <tr> <td>5</td> <td>重庆机电股份有限公司</td> <td>02722.HK</td> <td>368,464</td> <td>23,213</td> <td>6.30</td> </tr> <tr> <td>6</td> <td>金科地产集团股份有限公司</td> <td>000656</td> <td>534,336</td> <td>4,185</td> <td>0.78</td> </tr> </tbody> </table>						序号	投资上市企业	股票代码	总股本(万元)	持股数(万股)	持股比例(%)	1	重庆银行股份有限公司	01963.HK	312,700	40,701	13.02	2	重庆川仪自动化股份有限公司	603100	39,500	5,138	13.01	3	中房地产股份有限公司	000736	29,719	3,176	10.69	4	重庆农村商业银行股份有限公司	03618.HK	930,000	62,930	6.77	5	重庆机电股份有限公司	02722.HK	368,464	23,213	6.30	6	金科地产集团股份有限公司	000656	534,336	4,185	0.78
序号	投资上市企业	股票代码	总股本(万元)	持股数(万股)	持股比例(%)																																											
1	重庆银行股份有限公司	01963.HK	312,700	40,701	13.02																																											
2	重庆川仪自动化股份有限公司	603100	39,500	5,138	13.01																																											
3	中房地产股份有限公司	000736	29,719	3,176	10.69																																											
4	重庆农村商业银行股份有限公司	03618.HK	930,000	62,930	6.77																																											
5	重庆机电股份有限公司	02722.HK	368,464	23,213	6.30																																											
6	金科地产集团股份有限公司	000656	534,336	4,185	0.78																																											

#### 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	重庆市国有资产监督管理委员会
单位负责人或法定代表人	胡际权

**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

报告期内，根据控股股东重庆渝富来函，重庆市国资委持有的重庆渝富 100% 股权全部无偿划转给重庆渝富控股集团有限公司并于 2016 年 8 月取得重庆市工商行政管理局出具的《准予变更登记通知书》。重庆渝富由重庆市国资委履行出资人职责的国有独资公司变更为法人独资的有限责任公司，重庆渝富控股集团有限公司为重庆市国资委履行出资人职责的国有独资公司。重庆渝富为重庆渝富控股集团有限公司的全资子公司，实际控制人未变化，仍为重庆市国资委。

有关内容详见 2016 年 8 月 20 日、8 月 29 日刊载于公司选定的信息披露报纸及中国证监会指定网站的《提示性公告》。

### 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
廖庆轩	董事长	男	55	2016.7.15	至今					43.20	否
李剑铭	董事	男	54	2014.1.27	至今					8.33	是
吴坚	董事	男	52	2016.8.3	至今					40.14	否
	总裁			2016.7.18	至今						
	副总裁			2014.2.14	2016.7.18						
王珠林	董事	男	52	2009.3.5	2017.3.21					0	是
江峡	董事	女	48	2010.4.29	2017.3.21					0	是
吴军	独立董事	男	63	2009.3.16	至今					10	否
刘轶菡	独立董事	女	68	2012.11.30	至今					10	否
张力上	独立董事	男	58	2013.7.31	至今					10	否
崔坚	原董事长	男	61	2013.5.20	2016.2.15					2.30	否
余维佳	原董事、总裁	男	53	2012.4.26	2016.7.18					26.04	否
蒋辉	监事会主席	男	57	2010.9.28	至今					44.60	否
高文志	监事	男	46	2009.2.15	至今					4.00	否
李波	职工监事	男	48	2013.6.8	至今					142.22	否
张纯勇	董事	男	51	2017.3.21	至今					35.68	否
张纯勇	副总裁	男	51	2009.2.15	至今					35.68	否
徐鸣镝	副总裁、 董事会秘书	男	47	2009.2.15	至今					35.68	否
李勇	副总裁、合规总 监、首席风险官	男	50	2009.2.15	至今					35.68	否



侯曦蒙	副总裁	女	46	2010.9.16	至今					35.68	否
蒲锐	副总裁	男	43	2015.4.30	至今					35.68	否
合计	/	/	/	/	/				/	519.23	/

- 注：1. 崔坚先生于 2016 年 2 月 2 日书面提请辞去公司第七届董事会董事长、董事会战略委员会主任委员、董事职务。  
 2. 余维佳先生于 2016 年 7 月 17 日书面提请辞去公司总裁、公司第七届董事会战略委员会委员、风险控制委员会主任委员及董事职务。  
 3. 公司董事长、监事会主席、高级管理人员 2016 年度的税前薪酬总额仍在确认过程中，将提交董事会审核确定，待确认后再另行披露。

姓名	主要工作经历
廖庆轩	硕士研究生，高级经济师，中共党员，现任公司董事长、党委书记，第十二届全国人大代表。廖庆轩先生曾在中国人民银行重庆分行、中国工商银行重庆分行、华夏证券重庆公司、重庆市证券管理办公室筹备组、重庆市商业银行、重庆市国资委、重庆渝富资产管理集团有限公司、重庆市人民政府等单位工作，先后任重庆市商业银行行长；重庆市国资委副主任（正厅局长级）；重庆市人民政府副秘书长（正厅局长级）；重庆渝富资产管理集团有限公司董事长、党委书记；重庆市国资委主任、党委副书记等职务。
李剑铭	经济学博士，高级经济师，享受国务院政府特殊津贴专家，中共党员，现任公司董事，重庆渝富资产管理集团有限公司党委书记、董事长；重庆渝富控股集团有限公司董事长；中新互联互通投资基金管理有限公司董事长；重庆渝富资本股权投资基金管理有限公司董事长；还担任中共重庆市第四届委员会委员；重庆市第四次党代会代表，重庆市第四届人大代表。李剑铭先生于 1982 年参加工作，曾任深圳市华夏实业股份有限公司执行董事、总经理；深圳市先科实业投资股份有限公司执行董事、总经理；深圳先科企业集团总经济师；重庆市沙坪坝区人民政府副区长；重庆市证券监督管理办公室副主任；重庆市国资委副主任、党委委员；重庆建工集团有限责任公司董事长、总经理、党委委员，党委书记、董事长；中共重庆市沙坪坝区委书记；重庆市第三次党代会代表；重庆市第三届人大代表。
吴坚	研究生，中共党员，现任公司董事、总裁、党委副书记，兼任重庆市证券期货业协会会长；重庆股份转让中心有限责任公司董事长；西证国际投资有限公司董事长；西证国际证券股份有限公司董事会主席；重庆仲裁委仲裁员。吴坚先生曾任重庆市经济体制改革委员会主任科员；重庆市证券监督管理办公室副处长；重庆证监局上市处处长；重庆渝富资产管理集团有限公司党委委员、副总经理；重庆东源产业投资股份有限公司董事长；重庆机电股份有限公司董事；重庆上市公司董事长协会秘书长；西南证券有限责任公司董事；安诚财产保险股份有限公司副董事长；重庆银海融资租赁有限公司董事长；重庆直升机产业投资有限公司副董事长；华融渝富股权投资基金管理有限公司副董事长；西南药业股份有限公司独立董事；西南证券股份有限公司董事；西南证券股份有限公司副总裁；西证国际投资有限公司董事；西证国际证券股份有限公司执行董事。
王珠林	经济学博士，中共党员，报告期任公司董事、党委委员，银华基金管理股份有限公司董事长，中国上市公司协会并购融资委员会执行主任，中国退役士兵就业创业服务促进会副理事长，中证机构间报价系统股份有限公司董事，中航动力股份有限公司独立董事，中国中材股份有限公司独立董事，财政部资产评估准则委员会委员。王珠林先生于 1987 年参加工作，曾任甘肃省职工财经学院财会系讲师；甘肃省证券公司发行部经理、投资银行部经理；中国蓝星化学工业总公司证券投资处处长；蓝星清洗股份有限公司董事副总经理兼董事会秘书；新材料股份公司筹备组长；西南有限党委委员、副总裁；中国证监会发行审核委员会委员；中国证券业协会投资银行专业委员会委员；中国银河证券股份有限公司副总裁；西南有限公司党委副书记、董事、总裁；中国证监会上市公司并购重组审核委员会委员；西南证券党委副书记、董事、总裁；银华基金管理股份有限公司副董事长；重庆证券期货业协会会长。
江峡	硕士研究生，中共党员，报告期任公司董事，现任中建投信托有限责任公司副总经理，建投书店投资有限公司董事。江峡女士于 1990 年参加工作，曾任中国建设银行总行科技部主任科员；中信控股有限责任公司风险管理部高级经理；中国建投审计与风险控制部高级业务副经理；中国建投风险

	管理部高级业务经理；中国建投法律合规部负责人、业务总监；中国投资咨询有限责任公司副总经理。
吴军	博士、教授，中共党员，现任公司独立董事，对外经济贸易大学金融学院教授，西证国际证券股份有限公司独立非执行董事，浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司独立董事。吴军先生于 1970 年参加工作，曾任云南财贸学院金融系讲师、教研室主任；中国金融学院副教授、教授、系主任；对外经济贸易大学金融学院院长；深圳市深信泰丰（集团）股份有限公司独立董事。
刘轶茂	本科学历，高级经济师，中共党员，现任公司独立董事。刘轶茂女士于 1970 年参加工作，历任重庆市政府办公厅三处副处长、处长；重庆市政府副秘书长兼重庆市证券监管办公室主任；重庆市商业委员会副主任；重庆市国资委副主任；重庆联合产权交易所股份有限公司党委书记、董事长；重庆联合产权交易所股份有限公司一级资深经理。
张力上	硕士，会计学教授，民革成员，中国注册会计师非执业会员，现任公司独立董事，西南财经大学会计学院教授委员会主席，会计系主任，四川科新机电股份有限公司独立董事。张力上先生于 1982 年参加工作，历任成都精准会计公司副总经理；成都信达会计师事务所资产评估部副主任；四川嘉禾股份有限公司独立董事；北京互信互通股份有限公司独立董事；成都前锋电子股份有限公司独立董事；吉峰农机连锁股份有限公司独立董事；成都卫士通信息产业股份有限公司独立董事；盛和资源控股股份有限公司独立董事；西南科技大学兼职教授。
崔坚	硕士研究生，中共党员，报告期内曾任公司党委书记、董事长，重庆股份转让中心有限责任公司董事长。崔坚先生还担任第十二届全国人大代表，中共重庆市第四届市委委员，重庆市第四次党代会代表。崔坚先生于 1972 年参加工作，曾任重庆市政府副秘书长；重庆市政府办公厅副主任、党组副书记（正厅局级）兼重庆市政府金融工作办公室主任、兼重庆市整顿金融“三乱”办公室主任；重庆市国资委主任、党委常务副书记；西证创新投资有限公司董事长；第十一届全国人大代表；重庆市第三届市委委员；重庆市第三次党代会代表。
余维佳	博士，高级经济师，中共党员，报告期内曾任公司董事、总裁，西证股权投资有限公司董事长，西证国际投资有限公司董事长，西证重庆股权投资基金管理有限公司董事长，重庆证券期货业协会会长，西证国际证券股份有限公司董事会主席。余维佳先生于 1989 年参加工作，曾任招商局蛇口工业区发展研究室研究员、企业管理室部长；深圳市半岛投资基金管理公司副总经理、总经理；招商证券股份有限公司副总裁、常务副总裁、首席运营官，兼任招商证券（香港）有限公司董事长。
蒋辉	经济学博士、博士后，中共党员，现任公司监事会主席，党委委员。蒋辉先生曾任西南财经大学统计系教师；海南省富南国际信托投资公司证券部经理；海南港澳国际信托投资公司证券部经理；重庆市证券监管办公室机构部主任兼上市部副主任；重庆证监局上市处处长；重庆证监局党委委员、副局长；西南证券有限责任公司党委书记、董事长；西南证券股份有限公司党委书记、董事长、副董事长；重庆市证券期货业协会会长。
高文志	博士，中共党员，现任公司监事，平安信托有限责任公司北京区域事业群事业三部总监。高文志先生于 1992 年参加工作，曾任河北省政府外事办公室科员；中国建设银行总行政研室、研发部、投资银行部副主任科员、主任科员；中国建设银行甘肃省兰州市电力支行行长助理（挂职锻炼）；中国建投投资银行部高级副经理；西南有限监事；中国建投研究中心高级经理；财富期货有限公司董事；中国金谷国际信托有限责任公司高级经理。
李波	本科学历，中共党员，会计师、高级审计师，现任公司监事，公司审计部总经理、重庆市内部审计协会常务理事。李波先生于 1988 年参加工作，曾任重庆市审计局外资审计处、行政事业审计处、办公室、金融审计处科员、副主任科员、主任科员；西南有限审计稽核部总经理助理、副总经理、总经理。
张纯勇	硕士研究生，中共党员，现任公司董事、副总裁、党委委员，西南期货有限公司董事长。张纯勇先生于 1984 年参加工作，曾任解放军第 324 医院、第三军医大学附一院医生；重庆市出入境检验检疫局第一检验监管处副科长、科长、副处长；重庆证监局上市公司监管处负责人；西南合成制药股份有限公司（现为北大医药股份有限公司）董事长；重庆市人民政府金融工作办公室上市公司处处长、证券处处长；西南证券有限责任公司副总裁；西证创新投资有限公司董事长；重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司董事长；重庆西证小额贷款有限公司董事长；西证股权投资有限公司董事；

	西证重庆股权投资基金管理有限公司董事；西证国际投资有限公司董事；西证国际证券股份有限公司董事。
徐鸣镝	硕士，注册会计师，中共党员，现任公司副总裁、董事会秘书、党委委员。徐鸣镝先生于 1991 年参加工作，曾任黑龙江会计师事务所证券部副经理；中国证监会主任科员；西南有限总裁助理、副总裁、董事会秘书；西证创新投资有限公司董事；西证国际投资有限公司董事；西证国际证券股份有限公司董事。
李勇	研究生，中共党员，现任公司副总裁、合规总监、首席风险官、党委委员。李勇先生于 1988 年参加工作，曾任中国人民银行重庆市分行非银处市场科科长；中国证监会重庆监管局上市处副处长；重庆国际信托投资有限公司党委委员、工会主席兼综合管理部总经理；西南有限办公室主任、副总裁、合规总监；西证创新投资有限公司董事；西证重庆股权投资基金管理有限公司董事；西证股权投资有限公司董事。
侯曦蒙	硕士，中共党员，现任公司副总裁、党委委员。侯曦蒙女士于 1993 年参加工作，曾任西南有限人力资源部副总经理（主持工作）、经纪业务总部副总经理、办公室主任；西南证券总裁办公室主任；西证国际投资有限公司董事、总经理；重庆西证小额贷款有限公司董事。
蒲锐	经济学硕士，中共党员，现任公司副总裁、党委委员，西证国际投资有限公司董事、总经理，西证国际证券股份有限公司执行董事、行政总裁。蒲锐先生于 1994 年 8 月参加工作，曾任四川省证管办上市发行部副科长、科长；中国证监会成都证管办上市公司监管处副处长；中国证监会四川证监局上市公司监管一处副处长；中国证监会四川监管局上市二处处长（其间：2007 年 5 月至 2008 年 5 月挂职任四川省遂宁市人民政府市长助理）；中国证监会四川监管局稽查二处处长；西南证券股份有限公司总裁助理。

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	任期起始日期	任期终止日期
李剑铭	重庆渝富资产经营管理集团有限公司	董事长、党委书记	2013 年 9 月	至今

### (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	任期起始日期	任期终止日期
崔坚	重庆股份转让中心有限责任公司	董事长	2013 年 2 月	2016 年 2 月
李剑铭	中新互联互通投资基金管理有限公司	董事长	2016 年 7 月	至今

李剑铭	重庆渝富资本股权投资基金管理有限公司	董事长	2015年8月	至今
李剑铭	重庆渝富控股集团有限公司	董事长	2016年8月	至今
吴坚	重庆股份转让中心有限责任公司	董事、总裁	2013年10月	2016年5月
吴坚	重庆股份转让中心有限责任公司	董事长	2016年5月	至今
吴坚	西证国际投资有限公司	董事长	2016年11月	至今
吴坚	西证国际投资有限公司	董事	2015年3月	2016年11月
吴坚	西证国际证券股份有限公司	董事会主席	2016年11月	至今
吴坚	西证国际证券股份有限公司	董事	2015年2月	2016年10月
吴坚	银华基金管理股份有限公司	董事	2016年8月	至今
吴坚	重庆市证券期货业协会	会长	2017年1月	至今
余维佳	西证股权投资有限公司	董事长	2012年6月	2016年11月
余维佳	西证国际投资有限公司	董事长	2013年12月	2016年9月
余维佳	西证国际证券股份有限公司	董事会主席	2015年2月	2016年8月
余维佳	西证重庆股权投资基金管理有限公司	董事长	2013年7月	2016年8月
余维佳	重庆证券期货业协会	会长	2012年11月	2017年1月
王珠林	银华基金管理股份有限公司	董事长	2012年7月	至今
江峡	中建投信托有限责任公司	副总经理	2013年6月	至今
江峡	建投书店投资有限公司	董事	2015年4月	至今
吴军	对外经济贸易大学	教授	2000年6月	至今
吴军	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司	独立董事	2011年1月	至今
吴军	西证国际证券股份有限公司	独立非执行董事	2015年1月	至今
张力上	西南财经大学会计学院	会计学院教授委员会主席、 会计系主任	2009年12月	至今
张力上	成都卫士通信息产业股份有限公司	独立董事	2011年5月	2016年8月
张力上	盛和资源控股股份有限公司	独立董事	2013年1月	2016年7月
张力上	四川科新机电股份有限公司	独立董事	2014年10月	至今
高文志	平安信托有限责任公司	北京区域事业群事业三部总监	2015年2月	至今
李波	重庆市内部审计协会	常务理事	2012年2月	至今
张纯勇	西南期货有限公司	董事长	2013年12月	至今
张纯勇	西证创新投资有限公司	董事长	2015年1月	2016年10月
张纯勇	西证创新投资有限公司	董事	2016年10月	2017年3月

张纯勇	重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司	董事长	2013年5月	2017年3月
张纯勇	重庆西证小额贷款有限公司	董事长	2014年8月	2017年3月
张纯勇	西证股权投资有限公司	董事	2013年4月	2017年3月
张纯勇	西证重庆股权投资基金管理有限公司	董事	2013年7月	2017年3月
张纯勇	西证国际投资有限公司	董事	2015年3月	2017年3月
张纯勇	西证国际证券股份有限公司	董事	2015年2月	2017年3月
徐鸣镝	西证创新投资有限公司	董事	2013年4月	2017年3月
徐鸣镝	西证国际投资有限公司	董事	2015年3月	2017年3月
徐鸣镝	西证国际证券股份有限公司	董事	2015年2月	2017年3月
李勇	西证股权投资有限公司	董事	2014年2月	2017年3月
李勇	西证重庆股权投资基金管理有限公司	董事	2014年2月	2017年3月
李勇	西证创新投资有限公司	董事	2015年1月	2017年3月
侯曦蒙	重庆西证小额贷款有限公司	董事	2014年8月	2017年3月
蒲锐	西证国际投资有限公司	董事、总经理（其中2016年9-11月间代行董事长职责）	2015年3月	至今
蒲锐	西证国际证券股份有限公司	执行董事、行政总裁	2015年2月	至今

### 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	根据《公司章程》，董事、监事报酬由股东大会决定，高级管理人员报酬由董事会决定。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司董事、监事报酬标准参照上市券商水平及公司实际情况确定，高级管理人员的报酬按照公司薪酬制度确定，与绩效考核结果挂钩。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	报告期内，公司董事、监事和高级管理人员应付报酬总额为519.23万元。公司将按照相关规定执行高级管理人员绩效年薪的延期支付。报告期内公司未实行股权激励计划，没有非现金薪酬情况。
报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计	515.73万元

### 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
廖庆轩	董事长	选举	

吴坚	董事、总裁	选举	
崔坚	董事长	离任	退休
余维佳	董事、总裁	离任	个人原因

#### 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	2,949
主要子公司在职员工的数量	362
在职员工的数量合计	3,311
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	42
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
中后台部门	359
证券投资事业部	16
资产管理事业部	94
投资银行事业部	314
经纪业务事业部	1,991
新三板业务部	78
场外业务部	33
机构客户部	31
主要子公司	362
其他	33
合计	3,311
教育程度	
教育程度类别	数量(人)
博士研究生	36
硕士研究生	1,117
大学本科	1,823
大专及以下	335
合计	3,311

### (二) 薪酬政策

√适用 □不适用

公司年度薪酬总额由董事会确定。公司根据经营目标，结合证券行业特点，按照“公平、公正”的原则，以业绩为导向，搭建了市场化的员工薪酬体系。员工薪酬结构包括基本工资、绩效工资、福利等。按照《中华人民共和国劳动合同法》等相关法律、法规及地方政府的有关规定，公司为员工办理了各项社会统筹保险、住房公积金、企业年金。

### (三) 培训计划

√适用 □不适用

2016 年，随着国家着力推动各项金融改革，市场对证券行业提供的产品需求也更加多元化和深入化，为客户提供全方位的金融服务成为行业竞争的主旋律，提高业务协同运作的整体效率和竞争力已成为各证券公司寻求创新服务的突破口。公司在“重点打造市场领先的精英团队，全力助推业务协同发展”的目标指引下，立足经营实际，打造了可以快速进行知识分享、交流、学习的培训平台；精心组织了财务专题等各类业务培训，及时传递行业内的新动态、新趋势；以多种培训方式相结合的形式，着力解决新任管理者面临的困局；有计划

的安排员工参加了各级监管机构的定向培训；坚持合规、风控培训常抓不懈。2016 年的培训提高了各类人员的经营能力、创新能力和业务开拓能力，满足了公司转型发展的新要求。

2017 年，公司培训将继续围绕公司发展和业务需要，以建设创新驱动的一流券商为目标，以支持培育业务发展为中心，以公司内部的师资资源为依托，分层次、有重点的继续深耕培训工作，深化员工综合业务和创新业务的学习。

#### **(四) 劳务外包情况**

适用 不适用

#### **七、其他**

适用 不适用

截至 2016 年末，公司 128 家证券分支机构共有经纪人 1351 名，并已全部取得了证券经纪人资格。经纪人直接隶属于证券分支机构，不分序列和职级，不以团队方式进行管理，可通过公司网站、客户服务统一电话等方式查询经纪人的执业信息等资料。分支机构负责人作为第一管理责任人，全面具体负责经纪人管理工作，并接受公司总部的管理、协调和监督、检查。另外公司还建立经纪人风险监控系統，实现经纪人日常风险监控、评估及预警机制，有效控制经纪人风险。分支机构还定期通过面谈、电话、信函或者其他方式对经纪人招揽和服务的客户进行回访，了解经纪人的执业合规情况。



## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

公司严格遵循《公司法》、《证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《证券公司治理准则》及其它相关法规及规范性文件的要求，持续完善提升公司治理结构水平，健全公司治理制度体系，制定了《公司章程》、《公司股东大会议事规则》以及公司董、监事会议事规则、董事会各专门委员会工作细则、《公司总裁工作细则》等制度，公司治理符合监管机构的相关规定。

公司治理结构中，股东大会、董事会、监事会和经理层相互分离、相互制衡，共同推动公司科学决策、规范运作。公司各层级在职权范围内各司其职、各负其责，确保公司治理的规范有效，共同推进公司总体发展。报告期内，公司董、监事会成员人数及其构成情况符合监管要求及《公司章程》的相关规定。

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
2016 年第一次临时股东大会	2016 年 1 月 6 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2016 年 1 月 7 日
2016 年第二次临时股东大会	2016 年 3 月 2 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2016 年 3 月 3 日
2015 年度股东大会	2016 年 3 月 25 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2016 年 3 月 26 日
2016 年第三次临时股东大会	2016 年 8 月 3 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2016 年 8 月 4 日
2016 年第四次临时股东大会	2016 年 11 月 25 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2016 年 11 月 26 日

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 出席股东大会的次数
		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	
廖庆轩	否	3	3	0	0	0	否	1
崔坚	否	0	0	0	0	0	否	1
李剑铭	否	6	4	1	2	0	是	0
吴坚	否	2	2	0	0	0	否	1
余维佳	否	3	3	1	0	0	否	2
王珠林	否	6	6	1	0	0	否	0
江峡	否	6	4	1	2	0	否	0
吴军	是	6	6	1	0	0	否	2
刘轶菡	是	6	6	1	0		否	1

张力上	是	6	6	1	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

2016年8月26日，李剑铭董事因出差未能亲自出席公司第七届董事会第五十次会议，委托廖庆轩董事长出席会议并代为行使表决权并签署相关文件；2016年10月27日，李剑铭董事因公务出差未能亲自出席公司第七届董事会第五十一次会议，委托吴坚董事出席会议并代为行使表决权及签署相关文件。

年内召开董事会会议次数	6
其中：现场会议次数	5
通讯方式召开会议次数	1
现场结合通讯方式召开会议次数	0

(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

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

五、监事会发现公司存在风险的说明

适用 不适用

报告期内，公司监事会对监督事项无异议。

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

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

高管人员的考核按照有关部门对企业领导班子和领导人员综合考核评价相关规定执行，综合考核包括经营业绩考核、党的建设考核、综合测评等，公司董事会负责对高管人员的业绩考核。综合考核评价结果作为教育培养、管理监督、选拔任用、激励保障的重要依据。

## 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用  不适用

公司《2016 年度内部控制评价报告》全文于 2017 年 4 月 14 日发布于上海证券交易所网站 (<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

公司聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司内部控制进行了审计，并于 2017 年 4 月 12 日出具了无保留意见的内部控制审计报告。

是否披露内部控制审计报告：是

## 十、其他

适用  不适用

### （一）合规管理体系建设情况

公司拥有董事会、经理层及合规总监、合规管理部门和合规经理的四级合规管理组织体系，制订了明确的合规管理目标和基本原则，建立了规范的合规管理基本制度和工作程序。合规管理工作覆盖公司所有业务、各部门及分支机构以及全体工作人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节。公司合规总监与合规管理部门通过实施合规咨询、审查、监督、检查、报告等工作，对公司业务与管理活动进行合规性控制，通过实施合规培训和合规文化宣导，推行合规创造价值、全员合规、合规从高层做起的理念，引导公司全员合规意识、思维的形成，保持激励约束机制与公司合规文化和价值观的一致性，实现内部自律和外部监管的有效结合。

2016 年，公司加强了对监管信息、案例的及时收集与传递，新增了微信公众号、公司月刊等宣导途径，形成了多渠道、动态的合规信息快速传递机制，提升全员的合规意识；建立了重大合规风险报告制度，实现了风险的及时发现、响应与处置；强化合规问责工作，增强全员对合规文化的敬畏感；进一步加强对子公司的合规管理全覆盖，积极探索高效的总部集中合规管理模式，不断完善与深化合规管理机制。

### （二）稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

报告期内，公司审计部门紧跟公司业务发展，以风险为导向开展工作，共计开展了 75 项审计和评估项目，具体如下：

专项审计 11 项，包括：投资银行业务、固定收益交易业务、清算业务、反洗钱、新三板业务、机构业务、信用交易业务和期权业务、信息技术、资管业务、流动性风险管理、公司工会财务收支情况。

子公司审计 5 项，包括：西证股权投资有限公司、重庆西证电子商务有限责任公司、西证重庆股权投资基金管理有限公司、西南期货有限公司的例行审计，另对西证股权投资有限公司总经理进行了离任审计。

分支机构审计 52 项，包括：分支机构负责人离任审计 23 项、强制离岗稽核 29 项。

其他项目 7 项，包括：年度内部控制自我评价、年度合规管理有效性评估、投资经理离任审计 5 项。

通过上述审计与评估工作，审计部门对公司的主要业务活动、内部控制和风险管理的有效性和适当性进行了审查和评价，对存在的主要风险进行了揭示，促进了公司各组织完善内控和风险管理水平。

## 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: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
西南证券股份有限公司 2014 年公司债券（第一期）	14 西南 01	122379	2015 年 6 月 10 日	2018 年 6 月 10 日	4,000,000,000	4.10%	本期债券采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
西南证券股份有限公司 2014 年公司债券（第二期）	14 西南 02	122404	2015 年 7 月 23 日	2020 年 7 月 23 日	2,000,000,000	3.67%	本期债券采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所

### 公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

1. 西南证券股份有限公司 2014 年公司债券（第一期）期限为 3 年，付息日期为 2016 年至 2018 年每年的 6 月 10 日，兑付日期为 2018 年 6 月 10 日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。

2. 西南证券股份有限公司 2014 年公司债券（第二期）期限为 5 年，附第 3 年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权，付息日期为 2016 年至 2020 年间每年的 7 月 23 日，如投资者行使回售选择权，则其回售部分债券的付息日为 2016 年至 2018 年间每年的 7 月 23 日；兑付日期为 2020 年 7 月 23 日，如投资者行使回售选择权，则其回售部分债券的兑付日为 2018 年 7 月 23 日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日；顺延期间不另计息。

3. 2016 年 6 月 13 日，公司按时、足额支付了 2014 年公司债券（第一期）2015 年 6 月 10 日至 2016 年 6 月 9 日期间的利息，利率 4.10%（含税），总付息金额为 16,400.00 万元。

4. 2016 年 7 月 25 日，公司按时、足额支付了 2014 年公司债券（第二期）2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 22 日期间的利息，利率 3.67%（含税），总付息金额为 7,340.00 万元。

### 公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

1. 此处列示的公司债券仅包含公司在中华人民共和国境内公开发行并在证券交易所上市或转让，且在报告期末未到期的公司债券，不包含次级债。

2. 以上所列示的利率均为票面利率。

3. 以上债券发行均面向合格投资者发行。

### 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

债券受托管理人	名称	东吴证券股份有限公司
---------	----	------------

	办公地址	苏州工业园区星阳街 5 号
	联系人	苏北、刘科峰、贝一飞
	联系电话	0512-62938508
资信评级机构	名称	联合信用评级有限公司
	办公地址	天津市南开区水上公园北道 38 号爱俪园公寓 508

其他说明：

适用 不适用

报告期内公司聘请的债券受托管理人、资信评级机构未发生变更。

### 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

公司债券的募集资金在扣除发行费用后，全部用于补充公司营运资金。截至目前，公司债券所募得的资金已经全部使用完毕，募集资金的使用符合《西南证券股份有限公司公开发行 2014 年公司债券募集说明书》中的募集资金运用承诺。

### 四、公司债券评级情况

适用 不适用

公司聘请联合信用评级有限公司对“14 西南 01”、“14 西南 02”公司债券进行评级。根据联合信用评级有限公司出具的《西南证券股份有限公司 2014 年公司债券信用评级报告》（联合评字[2015]153 号），公司的主体信用评级为 AAA，公司“14 西南 01”、“14 西南 02”公司债券的债项信用评级均为 AAA。

联合信用评级有限公司将在公司债券存续期内，每年公司发布年度报告后 2 个月内对公司债券进行一次定期跟踪评级，并在公司债券存续期内根据有关可能导致信用等级变化的情况进行不定期跟踪评级。2016 年 4 月 8 日，联合信用评级有限公司对公司已发行的公司债券“14 西南 01”和“14 西南 02”的信用状况进行了跟踪评级，并出具了《西南证券股份有限公司公司债券 2016 年跟踪评级报告》，维持公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望稳定；维持公司公司债券“14 西南 01”和“14 西南 02”债项信用等级为 AAA。

### 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

本次公司债券未采用第三方担保、资产抵押、质押担保等增信机制。

本次债券发行后，本公司根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于每年的利息支付和到期的本金兑付，以充分保障投资者的利益。

报告期内，本次公司债券的偿债计划及其他相关情况未发生重大变化。

## 六、公司债券持有人会议召开情况

√适用 □不适用

公司在报告期内不存在《非公开发行公司债券项目承接负面清单指引》附件中所列的有关情形，根据公司和债券受托管理人共同制定的《债券持有人会议规则》，并未涉及需召开债券持有人会议的情形。

## 七、公司债券受托管理人履职情况

√适用 □不适用

报告期内，本次公司债券受托管理人依据《公司债券发行与交易管理办法》、《公司债券受托管理人执业行为准则》、《债券受托管理协议》的相关规定履行职责，保障本期债券持有人的合法权益。

## 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	2,041,327,643.15	6,072,327,551.28	-66.38	利润总额减少
流动比率	1.71	1.90	-10.00	
速动比率	1.71	1.90	-10.00	
资产负债率	65.92%	62.82%	4.93	
EBITDA 全部债务比	0.06	0.21	-71.43	利润总额减少
利息保障倍数	2.43	3.67	-33.79	利润总额减少
现金利息保障倍数	-11.75	3.15		因行情原因，代理买卖证券款减少，导致经营活动产生现金流量为负。
EBITDA 利息保障倍数	2.60	3.73	-30.29	利润总额减少
贷款偿还率	100%	100%	0.00	
利息偿付率	100%	100%	0.00	

## 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

公司其他债券和债务融资工具主要包括：短期公司债券、次级债、融资融券收益权转让、固定收益凭证、证金公司转融通以及同业拆借等。报告期内，各项债券和债务融资工具均按照合同或相关约定按期足额付息兑付，未发生违约情况。

## 十、公司报告期内的银行授信情况

√适用 □不适用

公司资信状况优良，与工商银行、建设银行、农业银行、交通银行、招商银行等国内主要银行保持着长期合作伙伴关系，截至报告期末，本公司（母公司）已获得主要贷款银行各类授信额度 407 亿元人民币，尚未使用的授信额度为 367.13 亿元人民币。

#### 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

公司在报告期内严格执行公司债券募集说明书中的相关约定或承诺，未发生损害债券投资者利益的情形。

#### 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 6 月 23 日，公司收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字 2016975 号），内容为：“因你公司涉嫌未按规定履行职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

2017 年 3 月 17 日，公司收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字 2017194 号），内容为：“因你公司在从事上市公司并购重组财务顾问业务活动中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，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

报告期内，公司及子公司通过发行短期公司债券、次级债券、固定收益凭证等方式，累计发行债券 180 亿元，超过上年末净资产的 20%，属于《公司债券发行与交易管理办法》第四十五条规定之重大事项。

报告期内不存在对公司经营情况和偿债能力产生重大不利影响的未披露事项。



## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

√适用□不适用

# 审 计 报 告

天健审〔2017〕8-54 号

西南证券股份有限公司全体股东：

我们审计了后附的西南证券股份有限公司（以下简称西南证券）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、合并及母公司股东权益变动表，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西南证券管理层的责任，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误导致的重大错报。

### 二、注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为，西南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，公允反映了西南证券 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。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：李 斌

中国·杭州

中国注册会计师：陈丘刚

二〇一七年四月十二日

## 二、财务报表

**合并资产负债表**  
 2016 年 12 月 31 日

编制单位：西南证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金	1	18,127,955,171.10	22,205,059,526.75
其中：客户存款		11,177,627,392.18	16,870,396,029.80
结算备付金	2	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
其中：客户备付金		3,031,028,158.89	3,401,144,238.78
融出资金	3	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	5	21,534,339,752.67	16,376,728,884.07
衍生金融资产	7	5,451,641.47	602,698.95
买入返售金融资产	8	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84
应收款项	9	197,767,003.24	970,637,720.98
应收利息	10	538,898,651.77	414,863,179.56
存出保证金	11	625,158,757.97	998,317,476.91
可供出售金融资产	14	11,632,792,839.82	10,169,611,118.09
持有至到期投资	15	99,441,565.00	293,602,122.20
长期股权投资	17	1,621,964,192.55	1,655,217,844.00
投资性房地产	18	42,692,703.64	46,180,052.06
固定资产	19	335,328,716.71	315,975,350.79
在建工程	20	285,779,102.36	240,736,919.65
无形资产	21	194,334,634.69	176,103,740.01
商誉	23	283,060,313.45	265,786,152.94
递延所得税资产	25	162,122,654.79	230,651,648.28
其他资产	26	733,221,648.33	1,583,697,811.77
资产总计		70,999,692,045.13	71,749,438,233.09
<b>负债：</b>			
应付短期融资款	29	7,368,400,000.00	1,300,000,000.00
拆入资金	30		885,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	31	5,490,490,745.17	3,772,653,089.25
衍生金融负债	7	179,666,955.88	164,710,328.99
卖出回购金融资产款	32	9,680,845,721.37	10,331,801,349.72
代理买卖证券款	33	13,292,127,523.64	19,064,859,186.98
应付职工薪酬	38	1,000,181,468.37	1,476,768,598.06
应交税费	39	163,708,384.51	350,758,648.81
应付款项	37	139,615,260.36	656,112,350.76
应付利息	40	341,155,812.48	410,529,570.73
预计负债	47	64,180,032.69	
应付债券	43	13,447,553,351.21	12,714,977,017.90
递延所得税负债	25	8,239,428.84	153,414,050.84
其他负债	49	155,743,389.49	877,714,897.42
负债合计		51,331,908,074.01	52,159,299,089.46
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	51	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00

资本公积	53	7,852,067,958.06	7,852,067,958.06
其他综合收益	55	42,534,694.42	242,707,140.38
盈余公积	57	926,129,306.65	827,228,843.10
一般风险准备	58	1,775,278,624.90	1,577,477,697.80
未分配利润	59	2,760,152,434.68	2,873,145,282.45
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		19,001,272,142.71	19,017,736,045.79
少数股东权益		666,511,828.41	572,403,097.84
所有者权益（或股东权益）合计		19,667,783,971.12	19,590,139,143.63
负债和所有者权益（或股东权益）总计		70,999,692,045.13	71,749,438,233.09

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：李勇

会计机构负责人：牟光全

**母公司资产负债表**

2016 年 12 月 31 日

编制单位：西南证券股份有限公司

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		15,805,966,481.75	19,409,111,717.79
其中：客户存款		10,579,393,257.23	16,463,103,751.44
结算备付金		2,838,128,517.04	3,166,121,271.22
其中：客户备付金		2,304,085,573.98	2,213,306,075.01
融出资金		7,825,820,017.29	9,406,397,089.04
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		14,441,228,108.27	13,764,818,195.56
衍生金融资产		217,678.67	
买入返售金融资产		2,533,907,230.66	789,731,663.84
应收款项	1	41,158,892.65	7,647,855.22
应收利息		365,204,205.21	361,493,327.53
存出保证金		435,801,325.60	1,315,042,312.56
可供出售金融资产		9,569,315,916.50	9,466,434,074.07
长期股权投资	2	5,623,130,547.35	4,626,984,198.80
投资性房地产		36,773,481.67	39,463,951.21
固定资产		319,545,862.08	304,743,495.03
在建工程		285,779,102.36	240,736,919.65
无形资产		188,290,057.14	172,043,496.17
递延所得税资产		114,127,098.09	164,889,060.56
其他资产	3	362,609,265.43	581,385,769.87
资产总计		60,787,003,787.76	63,817,044,398.12
<b>负债：</b>			
应付短期融资款		7,368,400,000.00	1,300,000,000.00
拆入资金			885,000,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		7,628,000.00	
衍生金融负债		12,189,930.17	79,156,685.58
卖出回购金融资产款		8,939,845,721.37	10,331,801,349.72
代理买卖证券款		12,298,424,590.05	17,870,995,226.80
应付职工薪酬		920,304,584.29	1,378,351,930.53
应交税费		147,640,191.69	303,963,131.57
应付款项		64,873,035.07	522,872,986.31
应付利息		331,051,642.36	402,148,595.68
预计负债		71,636,032.69	
应付债券		11,963,437,167.47	11,245,549,193.17
递延所得税负债		11,819,357.92	138,213,034.59
其他负债		106,970,597.32	831,117,822.28
负债合计		42,244,220,850.40	45,289,169,956.23
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		5,645,109,124.00	5,645,109,124.00
资本公积		7,852,722,882.56	7,852,722,882.56
其他综合收益		-28,178,930.61	212,053,023.29
盈余公积		926,129,306.65	827,228,843.10

一般风险准备		1,775,278,624.90	1,577,477,697.80
未分配利润		2,371,721,929.86	2,413,282,871.14
所有者权益（或股东权益）合计		18,542,782,937.36	18,527,874,441.89
负债和所有者权益（或股东权益）总计		60,787,003,787.76	63,817,044,398.12

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：李勇

会计机构负责人：牟光全

**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		3,631,659,620.90	8,496,799,180.16
手续费及佣金净收入	60	2,413,198,433.38	4,307,367,941.55
其中: 经纪业务手续费净收入		844,082,619.19	2,079,969,456.41
投资银行业务手续费净收入		1,367,740,095.65	1,469,090,012.50
资产管理业务手续费净收入		113,035,455.80	682,519,606.71
利息净收入	61	34,370,191.52	213,841,229.09
投资收益(损失以“-”号填列)	62	1,370,586,687.23	3,948,018,572.82
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		151,874,016.03	262,709,865.79
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	63	-285,222,186.39	-65,146,630.45
汇兑收益(损失以“-”号填列)		83,311,977.77	78,911,664.78
其他业务收入	64	15,414,517.39	13,806,402.37
二、营业支出		2,474,064,211.40	4,230,702,247.50
税金及附加	65	122,657,115.78	524,009,006.96
业务及管理费	66	2,332,618,709.27	3,266,806,869.83
资产减值损失	67	13,372,747.45	433,329,191.59
其他业务成本	68	5,415,638.90	6,557,179.12
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,157,595,409.50	4,266,096,932.66
加: 营业外收入	69	40,369,136.90	87,757,668.69
减: 营业外支出	70	71,433,768.32	11,112,597.74
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,126,530,778.08	4,342,742,003.61
减: 所得税费用	71	213,829,400.70	797,681,872.16
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		912,701,377.38	3,545,060,131.45
其中: 归属于母公司所有者(或股东)的净利润		917,572,729.00	3,554,650,541.89
少数股东损益		-4,871,351.62	-9,590,410.44
六、其他综合收益的税后净额		-179,319,796.13	-438,017,070.48
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-200,172,445.96	-440,635,218.59
(一) 以后不能重分类进损益的其他综合收益		-1,942,904.64	-5,679,202.00
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动		-1,942,904.64	-5,679,202.00
(二) 以后将重分类进损益的其他综合收益		-198,229,541.32	-434,956,016.59
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		585,467.50	652,004.55
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-201,072,466.88	-492,866,089.99
3. 外币财务报表折算差额		43,247,882.08	22,150,709.46
4. 其他		-40,990,424.02	35,107,359.39
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		20,852,649.83	2,618,148.11
七、综合收益总额		733,381,581.25	3,107,043,060.97
归属于母公司所有者的综合收益总额		717,400,283.04	3,114,015,323.30
归属于少数股东的综合收益总额		15,981,298.21	-6,972,262.33
八、每股收益:			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.16	0.63
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.16	0.63

法定代表人: 吴坚

主管会计工作负责人: 李勇

会计机构负责人: 牟光全

**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		3,447,347,645.85	7,639,628,035.12
手续费及佣金净收入	4	2,336,700,951.57	4,219,622,574.50
其中:经纪业务手续费净收入		842,322,660.56	2,087,026,490.09
投资银行业务手续费净收入		1,325,077,663.50	1,428,987,002.68
资产管理业务手续费净收入		163,427,901.63	696,367,290.86
利息净收入	5	-50,213,036.04	248,435,212.47
投资收益(损失以“-”号填列)	6	1,295,713,275.32	3,112,599,455.71
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		151,874,016.03	262,709,865.79
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7	-149,297,904.89	45,767,025.22
汇兑收益(损失以“-”号填列)		2,021,837.85	1,611,553.19
其他业务收入		12,422,522.04	11,592,214.03
二、营业支出		2,204,407,712.16	3,788,426,832.98
税金及附加		94,632,122.02	491,567,131.32
业务及管理费		2,040,891,852.82	2,980,492,189.38
资产减值损失		64,562,170.96	310,591,934.97
其他业务成本		4,321,566.36	5,775,577.31
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,242,939,933.69	3,851,201,202.14
加:营业外收入		21,114,788.02	64,922,217.48
减:营业外支出		78,375,126.10	10,477,239.24
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,185,679,595.61	3,905,646,180.38
减:所得税费用		196,674,960.12	690,148,073.29
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		989,004,635.49	3,215,498,107.09
六、其他综合收益的税后净额		-240,231,953.90	-125,394,002.54
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益		-1,942,904.64	-5,679,202.00
1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动		-1,942,904.64	-5,679,202.00
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益		-238,289,049.26	-119,714,800.54
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		585,467.50	652,004.55
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		-238,874,516.76	-142,992,309.15
3.其他			22,625,504.06
七、综合收益总额		748,772,681.59	3,090,104,104.55
八、每股收益:			
(一)基本每股收益(元/股)			
(二)稀释每股收益(元/股)			

法定代表人:吴坚

主管会计工作负责人:李勇

会计机构负责人:牟光全

**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			558,512,675.70
收取利息、手续费及佣金的现金		5,175,034,109.27	7,034,750,640.99
融出资金净减少额		2,070,006,536.57	
代理买卖证券收到的现金净额			8,373,501,511.07
收到其他与经营活动有关的现金	73	814,304,852.92	116,069,272.57
经营活动现金流入小计		8,059,345,498.76	16,082,834,100.33
买入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		5,150,483,739.47	
融出资金净增加额			1,752,638,597.41
代理买卖证券支付的现金净额		5,772,731,663.34	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,139,340,250.32	2,140,171,129.81
支付给职工以及为职工支付的现金		2,196,323,165.05	1,889,632,009.58
支付的各项税费		707,440,502.31	1,256,557,860.47
拆入资金净减少额		885,000,000.00	1,997,000,000.00
回购业务资金净减少额		2,126,046,201.04	3,533,052,303.28
支付其他与经营活动有关的现金	73	697,675,519.78	1,056,326,636.78
经营活动现金流出小计		18,675,041,041.31	13,625,378,537.33
经营活动产生的现金流量净额		-10,615,695,542.55	2,457,455,563.00
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		712,511,533.28	
取得投资收益收到的现金		488,820,833.61	832,823,962.14
收到其他与投资活动有关的现金	73	3,040,896.12	597,389.13
投资活动现金流入小计		1,204,373,263.01	833,421,351.27
投资支付的现金		1,332,840,730.44	2,693,017,164.49
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		235,138,098.05	274,002,580.33
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			261,646,527.72
投资活动现金流出小计		1,567,978,828.49	3,228,666,272.54
投资活动产生的现金流量净额		-363,605,565.48	-2,395,244,921.27
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		102,710,262.00	15,100,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		102,710,262.00	15,100,000.00
发行债券收到的现金		18,068,400,000.00	17,341,069,193.17
收到其他与筹资活动有关的现金	73	1,742,919,848.94	2,764,759,518.49
筹资活动现金流入小计		19,914,030,110.94	20,120,928,711.66
偿还债务支付的现金		12,000,000,000.00	6,332,720,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,648,306,006.51	1,120,561,286.42
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		9,482,829.64	7,343,750.00
筹资活动现金流出小计		13,648,306,006.51	7,453,281,286.42
筹资活动产生的现金流量净额		6,265,724,104.43	12,667,647,425.24
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		54,839,526.49	1,611,430.55
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-4,658,737,477.11	12,731,469,497.52
加：期初现金及现金等价物余额		26,378,803,803.08	13,647,334,305.56
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		21,720,066,325.97	26,378,803,803.08

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：李勇

会计机构负责人：牟光全



**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			3,391,683,852.38
收取利息、手续费及佣金的现金		4,135,043,135.37	6,840,431,846.23
融出资金净减少额		1,583,857,933.45	
代理买卖证券收到的现金净额			7,382,526,102.44
收到其他与经营活动有关的现金	8	912,516,750.34	52,425,568.23
经营活动现金流入小计		6,631,417,819.16	17,667,067,369.28
买入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		641,933,330.76	
融出资金净增加额			1,050,447,976.54
代理买卖证券支付的现金净额		5,572,570,636.75	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,084,401,000.28	1,916,199,756.07
支付给职工以及为职工支付的现金		1,989,637,021.94	1,741,149,541.75
支付的各项税费		627,701,851.87	1,123,483,491.93
拆入资金净减少额		885,000,000.00	1,997,000,000.00
回购业务资金净减少额		3,001,524,383.35	2,770,271,845.97
支付其他与经营活动有关的现金	9	260,569,162.73	1,182,882,793.36
经营活动现金流出小计		14,063,337,387.68	11,781,435,405.62
经营活动产生的现金流量净额		-7,431,919,568.52	5,885,631,963.66
<b>二、投资活动产生的现金流量:</b>			
取得投资收益收到的现金		615,796,549.34	730,055,265.33
收到其他与投资活动有关的现金	10	4,031,379.82	289,079.48
投资活动现金流入小计		619,827,929.16	730,344,344.81
投资支付的现金		1,471,597,111.41	5,259,318,536.84
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		222,931,105.50	260,270,575.17
投资活动现金流出小计		1,694,528,216.91	5,519,589,112.01
投资活动产生的现金流量净额		-1,074,700,287.75	-4,789,244,767.20
<b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>			
发行债券收到的现金		18,068,400,000.00	15,881,069,193.17
筹资活动现金流入小计		18,068,400,000.00	15,881,069,193.17
偿还债务支付的现金		12,000,000,000.00	6,332,720,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,505,031,448.81	1,176,333,247.86
筹资活动现金流出小计		13,505,031,448.81	7,509,053,247.86
筹资活动产生的现金流量净额		4,563,368,551.19	8,372,015,945.31
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		12,113,314.86	1,611,553.19
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-3,931,137,990.22	9,470,014,694.96
加:期初现金及现金等价物余额		22,575,232,989.01	13,105,218,294.05
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		18,644,094,998.79	22,575,232,989.01

法定代表人: 吴坚

主管会计工作负责人: 李勇

会计机构负责人: 牟光全

**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	5,645,109,124.00	7,852,067,958.06		242,707,140.38		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,873,145,282.45	572,403,097.84	19,590,139,143.63
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	5,645,109,124.00	7,852,067,958.06		242,707,140.38		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,873,145,282.45	572,403,097.84	19,590,139,143.63
三、本期增减变动金额(减少以“—”号填列)				-200,172,445.96		98,900,463.55	197,800,927.10	-112,992,847.77	94,108,730.57	77,644,827.49
(一)综合收益总额				-200,172,445.96				917,572,729.00	15,981,298.21	733,381,581.25
(二)所有者投入和减少资本									87,610,262.00	87,610,262.00
1.股东投入的普通股									102,710,262.00	102,710,262.00
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									-15,100,000.00	-15,100,000.00
(三)利润分配						98,900,463.55	197,800,927.10	-1,030,565,576.77	-9,482,829.64	-743,347,015.76
1.提取盈余公积						98,900,463.55		-98,900,463.55		
2.提取一般风险准备							197,800,927.10	-197,800,927.10		
3.对所有者(或股东)的分配								-733,864,186.12	-9,482,829.64	-743,347,015.76
4.其他										
(四)所有者权益内部结转										
1.资本公积转增资本(或股本)										
2.盈余公积转增资本(或股本)										
3.盈余公积弥补亏损										
4.其他										
(五)专项储备										
1.本期提取										
2.本期使用										
(六)其他										
四、本期末余额	5,645,109,124.00	7,852,067,958.06		42,534,694.42		926,129,306.65	1,775,278,624.90	2,760,152,434.68	666,511,828.41	19,667,783,971.12

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	2,822,554,562.00	10,674,622,520.06		683,342,358.97		505,679,032.39	934,378,076.38	1,129,910,541.29	469,509,288.66	17,219,996,379.75
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	2,822,554,562.00	10,674,622,520.06		683,342,358.97		505,679,032.39	934,378,076.38	1,129,910,541.29	469,509,288.66	17,219,996,379.75
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00		-440,635,218.59		321,549,810.71	643,099,621.42	1,743,234,741.16	102,893,809.18	2,370,142,763.88
（一）综合收益总额				-440,635,218.59				3,554,650,541.89	-6,972,262.33	3,107,043,060.97
（二）所有者投入和减少资本									117,209,821.51	117,209,821.51
1. 股东投入的普通股									15,100,000.00	15,100,000.00
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									102,109,821.51	102,109,821.51
（三）利润分配						321,549,810.71	643,099,621.42	-1,811,415,800.73	-7,343,750.00	-854,110,118.60
1. 提取盈余公积						321,549,810.71		-321,549,810.71		
2. 提取一般风险准备							643,099,621.42	-643,099,621.42		
3. 对所有者（或股东）的分配								-846,766,368.60	-7,343,750.00	-854,110,118.60
4. 其他										
（四）所有者权益内部结转	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00								
1. 资本公积转增资本（或股本）	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00								
2. 盈余公积转增资本（或股本）										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 其他										
（五）专项储备										
1. 本期提取										
2. 本期使用										
（六）其他										
四、本期末余额	5,645,109,124.00	7,852,067,958.06		242,707,140.38		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,873,145,282.45	572,403,097.84	19,590,139,143.63

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：李勇

会计机构负责人：牟光全

**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	5,645,109,124.00	7,852,722,882.56		212,053,023.29		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,413,282,871.14	18,527,874,441.89
加:会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	5,645,109,124.00	7,852,722,882.56		212,053,023.29		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,413,282,871.14	18,527,874,441.89
三、本期增减变动金额(减少以“—”号填列)				-240,231,953.90		98,900,463.55	197,800,927.10	-41,560,941.28	14,908,495.47
(一)综合收益总额				-240,231,953.90				989,004,635.49	748,772,681.59
(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						98,900,463.55	197,800,927.10	-1,030,565,576.77	-733,864,186.12
1.提取盈余公积						98,900,463.55		-98,900,463.55	
2.提取一般风险准备							197,800,927.10	-197,800,927.10	
3.对所有者(或股东)的分配								-733,864,186.12	-733,864,186.12
(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	5,645,109,124.00	7,852,722,882.56		-28,178,930.61		926,129,306.65	1,775,278,624.90	2,371,721,929.86	18,542,782,937.36

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	2,822,554,562.00	10,675,277,444.56		337,447,025.83		505,679,032.39	934,378,076.38	1,009,200,564.78	16,284,536,705.94
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	2,822,554,562.00	10,675,277,444.56		337,447,025.83		505,679,032.39	934,378,076.38	1,009,200,564.78	16,284,536,705.94
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00		-125,394,002.54		321,549,810.71	643,099,621.42	1,404,082,306.36	2,243,337,735.95
（一）综合收益总额				-125,394,002.54				3,215,498,107.09	3,090,104,104.55
（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						321,549,810.71	643,099,621.42	-1,811,415,800.73	-846,766,368.60
1. 提取盈余公积						321,549,810.71		-321,549,810.71	
2. 提取一般风险准备							643,099,621.42	-643,099,621.42	
3. 对所有者（或股东）的分配								-846,766,368.60	-846,766,368.60
（四）所有者权益内部结转	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00							
1. 资本公积转增资本（或股本）	2,822,554,562.00	-2,822,554,562.00							
2. 盈余公积转增资本（或股本）									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 其他									
（五）专项储备									
1. 本期提取									
2. 本期使用									
（六）其他									
四、本期末余额	5,645,109,124.00	7,852,722,882.56		212,053,023.29		827,228,843.10	1,577,477,697.80	2,413,282,871.14	18,527,874,441.89

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：李勇

会计机构负责人：牟光全

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用□不适用

西南证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称证监会）证监许可〔2009〕62号文批准，由原西南证券有限责任公司借壳重庆长江水运股份有限公司，并依法承继原西南证券有限责任公司的各项证券业务资格而来。2009年2月17日，公司在重庆市工商行政管理局办理完成相关变更登记备案手续，公司名称变更为西南证券股份有限公司。截至2016年12月31日止，公司注册资本5,645,109,124.00元，股份总数5,645,109,124股（每股面值1元）。其中有限售条件的流通股份为1,000,000,000股（A股），无限售条件的流通股份4,645,109,124股（A股）。

本公司主要经营活动：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，融资融券，证券投资基金代销，代销金融产品，为期货公司提供中间介绍业务，股票期权做市。

本公司统一社会信用代码：91500000203291872B。

截至2016年12月31日止，公司拥有5家一级子公司，119家证券营业部；拥有员工3,311人，其中高级管理人员6人。

本财务报表业经公司2017年4月12日第八届董事会第二次会议批准对外报出。

#### 2. 合并财务报表范围

√适用□不适用

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，具体情况详见本年度报告“第十一节、财务报告 十、合并范围的变更和十一、在其他主体中的权益”之说明。

### 四、财务报表的编制基础

#### 1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

#### 2. 持续经营

√适用□不适用

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

### 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

□适用 √不适用

#### 1. 遵循企业会计准则的声明

本公司所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、股东权益变动和现金流量等有关信息。

## 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 3. 营业周期

适用 不适用

## 4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

## 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

### (1) 同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。公司按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值份额与支付的合并对价账面价值或发行股份面值总额的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

### (2) 非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；如果合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益。

## 6. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

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

## 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

### (1) 合营安排分为共同经营和合营企业。

### (2) 当公司为共同经营的合营方时，确认与共同经营中利益份额相关的下列项目：

- ① 确认单独所持有的资产，以及按持有份额确认共同持有的资产；
- ② 确认单独所承担的负债，以及按持有份额确认共同承担的负债；
- ③ 确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；

- ④按公司持有份额确认共同经营因出售资产所产生的收入；
- ⑤确认单独所发生的费用，以及按公司持有份额确认共同经营发生的费用。

## 8. 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

## 9. 客户交易结算资金

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

## 10. 外币业务和外币报表折算

√适用□不适用

### (1) 外币业务折算

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

### (2) 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

## 11. 金融工具

√适用□不适用

### (1) 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。



① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括交易性金融资产和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

i 交易性金融资产

公司将满足下列条件之一的金融资产划分为交易性金融资产：

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

ii 在初始确认时直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

A. 对于包括一项或多项嵌入衍生工具的混合工具，如果不是以下两种情况，公司将其直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：a. 嵌入衍生工具对混合工具的现金流量没有重大改变；b. 类似混合工具所嵌入的衍生工具，明显不应当从相关混合工具中分拆。

B. 除混合工具以外的其他金融资产，当直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产能够产生更相关的会计信息，则将其直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。符合下列条件之一，表明直接指定能产生更相关的会计信息：a. 该指定可以消除或明显减少由于该金融资产的计量基础不同而导致的相关利得或损失在确认和计量方面的不一致的情况；b. 公司的风险管理或投资策略的正式书面文件已载明，该金融资产组合以公允价值为基础进行管理、评价并向关键管理人员报告。

② 持有至到期投资

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

③ 贷款和应收款

公司将在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产划分为贷款和应收款。

④ 可供出售金融资产

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

2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债)、其他金融负债。

(2) 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或

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

公司按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：① 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；② 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

公司采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；② 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；③ 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：i 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；ii 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。② 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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

### (3) 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：1) 所转移金融资产的账面价值；2) 因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：1) 终止确认部分的账面价值；2) 终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

#### (4) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

- 1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；
- 3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

#### (5) 金融资产的减值测试和减值准备计提方法

1) 资产负债表日对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，如有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备。

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

#### 3) 可供出售金融资产

①表明可供出售债务工具投资发生减值的客观证据包括：

- i 债务人发生严重财务困难；
- ii 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；
- iii 公司出于经济或法律等方面因素的考虑，对发生财务困难的债务人作出让步；
- iv 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- v 因债务人发生重大财务困难，该债务工具无法在活跃市场继续交易；

vi 其他表明可供出售债务工具已经发生减值的情况。

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

本公司于资产负债表日对各项可供出售权益工具投资单独进行检查，若该权益工具投资于资产负债表日的公允价值低于其成本超过 50%或低于其成本持续时间超过 12 个月的，则表明其发生减值。对于本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，即本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，本公司以“若该权益工具投资于资产负债表日的公允价值低于其成本超过 50%或低于其成本持续时间超过 36 个月”，作为该投资计提减值准备的标准。

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

以成本计量的可供出售权益工具发生减值时，将该权益工具投资的账面价值，与按照类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额，确认为减值损失，计入当期损益，发生的减值损失一经确认，不予转回。

## 12. 应收款项

### (1) 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	单项金额重大的判断依据为金额 1,000 万元以上(含)且占应收款项账面余额 10%以上的款项。
单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备。

### (2) 按信用风险特征组合计提坏账准备的应收款项：

适用  不适用

按信用风险特征组合计提坏账准备的计提方法（账龄分析法、余额百分比法、其他方法）	
账龄分析法组合	账龄分析法
无收款风险组合	不计提坏账准备

组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的

适用  不适用

账龄	应收账款计提比例 (%)	其他应收款计提比例 (%)
1 年以内（含 1 年）	5	5
1—2 年	10	10
2—3 年	30	30

3—4 年	50	50
4—5 年	80	80
5 年以上	100	100

组合中，采用余额百分比法计提坏账准备的  
 适用  不适用

组合中，采用其他方法计提坏账准备的  
 适用  不适用

**(3) 单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项：**

适用  不适用

单项计提坏账准备的理由	应收款项的未来现金流量现值与以账龄为信用风险特征的应收款项组合的未来现金流量现值存在显著差异。
坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额计提坏账准备。

**13. 证券承销业务核算方法**

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

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

**14. 代兑付债券业务核算方法**

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

**15. 买入返售与卖出回购款项的核算方法**

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

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

买入返售及卖出回购的利息收支，在返售或回购期间内以实际利率确认。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收支。

除子公司西证国际证券股份有限公司外，公司按照约定购回资产负债表日余额的 0.30%、股票质押式回购资产负债表日余额的 0.50%计提减值准备。西证国际证券股份有限公司对上述业务未计提减值准备。

#### 16. 客户资产管理业务核算方法

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

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

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

#### 17. 转融通业务核算方法

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

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

#### 18. 协议安排业务核算方法

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

#### 19. 发起设立或发行产品业务核算方法

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

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

## 20. 划分为持有待售资产

√适用□不适用

公司将同时满足下列条件的非流动资产（不包含金融资产）划分为持有待售的资产：(1) 该组成部分必须在其当前状况下仅根据出售此类组成部分的通常和惯用条款即可立即出售；(2) 已经就处置该组成部分作出决议；(3) 与受让方签订了不可撤销的转让协议；(4) 该项转让很可能在一年内完成。

## 21. 长期股权投资

√适用□不适用

### (1) 共同控制、重要影响的判断

按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，认定为共同控制。对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定，认定为重大影响。

### (2) 投资成本的确定

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

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，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初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的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；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

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

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

① 在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

② 在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，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权益法核算下的其

他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期收益。但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。

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

### (3) 后续计量及损益确认方法

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

### (4) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的的处理方法

#### 1) 个别财务报表

对处置的股权，其账面价值与实际取得价款之间的差额，计入当期损益。对于剩余股权，对被投资单位仍具有重大影响或者与其他方一起实施共同控制的，转为权益法核算；不能再对被投资单位实施控制、共同控制或重大影响的，确认为可供出售金融资产，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的相关规定进行核算。

#### 2) 合并财务报表

##### ①通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且不属于“一揽子交易”的

在丧失控制权之前，处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整资本公积（资本溢价），资本溢价不足冲减的，冲减留存收益。

丧失对原子公司控制权时，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或合并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等，应当在丧失控制权时转为当期投资收益。

##### ②通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“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。

## 22. 投资性房地产

### (1) 如果采用成本计量模式的：

折旧或摊销方法

1) 投资性房地产为已出租的建筑物。



2) 投资性房地产按照成本进行初始计量, 采用成本模式进行后续计量, 并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。

## 23. 固定资产

### (1) 确认条件

适用  不适用

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

### (2) 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 (%)
房屋及建筑物	年限平均法	30-35	3	3.23-2.77
电子设备	年限平均法	3-5	3	32.33-19.40
机器设备	年限平均法	5-10	3	19.40-9.70
运输工具	年限平均法	4-6	3	24.25-16.17
办公设备	年限平均法	3-6	3	32.33-16.17

### (3) 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

适用  不适用

## 24. 在建工程

适用  不适用

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

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

## 25. 借款费用

适用  不适用

## 26. 无形资产

### (1) 计价方法、使用寿命、减值测试

适用  不适用

1) 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术, 按成本进行初始计量。

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

项 目	摊销年限(年)
交易席位费	10
软件	3
土地使用权	39.5

使用寿命不确定的无形资产不摊销,公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。

## (2) 内部研究开发支出会计政策

适用 不适用

## 27. 长期资产减值

适用 不适用

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

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

## 28. 长期待摊费用

适用 不适用

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

## 29. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

## 30. 职工薪酬

(1) 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

(2) 短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

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

(3) 离职后福利的会计处理方法

适用 不适用

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

1) 在职工为公司提供服务的会计期间,根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负

债，并计入当期损益或相关资产成本。

2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

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

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

③期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

#### (4) 辞退福利的会计处理方法

适用  不适用

向职工提供的辞退福利，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：1) 公司不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；2) 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

#### (5) 其他长期职工福利的会计处理方法

适用  不适用

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

### 31. 预计负债

适用  不适用

(1) 因对外提供担保、诉讼事项、产品质量保证、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。(2) 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

### 32. 股份支付

适用  不适用

**33. 优先股、永续债等其他金融工具**适用 不适用**34. 回购本公司股份**适用 不适用**35. 收入**适用 不适用**(1) 手续费及佣金收入**

1) 代理买卖证券业务收入，在代买卖证券交易日确认收入。

2) 证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：①采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；②采用余额包销、代销方式的，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

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

**(2) 利息收入**

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

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

融出资金、融出证券按资金使用时间和约定的利率确认当期利息收入。

**(3) 其他业务收入**

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

**36. 政府补助****(1) 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法**适用 不适用

公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助，确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内平均分配，计入当期损益。但是，按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

**(2) 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法**适用 不适用

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

### 37. 递延所得税资产/递延所得税负债

适用  不适用

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

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

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

(4) 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列情况产生的所得税：1) 企业合并；2) 直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

### 38. 租赁

#### (1) 经营租赁的会计处理方法

适用  不适用

公司为承租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金计入相关资产成本或确认为当期损益，发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

公司为出租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金确认为当期损益，发生的初始直接费用，除金额较大的予以资本化并分期计入损益外，均直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

#### (2) 融资租赁的会计处理方法

适用  不适用

### 39. 融资融券业务

适用  不适用

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

融资业务，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

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

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

除子公司西证国际证券股份有限公司外，公司按照融资融券资产负债表日余额的 0.20% 计提减值准备。西证国际证券股份有限公司对上述业务未计提减值准备。

#### 40. 持有待售资产

适用 不适用

#### 41. 资产证券化业务

适用 不适用

#### 42. 套期会计

适用 不适用

(1) 套期为公允价值套期。

(2) 对于满足下列条件的套期工具，运用套期会计方法进行处理：1) 在套期开始时，公司对套期关系(即套期工具和被套期项目之间的关系)有正式指定，并准备了关于套期关系、风险管理目标和套期策略的正式书面文件；2) 该套期预期高度有效，且符合公司最初为该套期关系所确定的风险管理策略；3) 对预期交易的现金流量套期，预期交易很可能发生，且必须使公司面临最终将影响损益的现金流量变动风险；4) 套期有效性能可靠地计量；5) 持续地对套期有效性进行评价，并确保该套期在套期关系被指定的会计期间内高度有效。

套期同时满足下列条件时，公司认定其高度有效：1) 在套期开始及以后期间，该项套期预期会高度有效地抵销套期指定期间被套期风险引起的公允价值或现金流量变动；2) 该套期的实际抵销结果在 80% 至 125% 的范围内。

(3) 套期会计处理

套期工具为衍生工具的，套期工具公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；套期工具为非衍生工具的，套期工具账面价值因汇率变动形成的利得或损失计入当期损益。

被套期项目因被套期风险形成的利得或损失计入当期损益，同时调整被套期项目的账面价值。

#### 43. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

#### 44. 重要会计政策和会计估计的变更

(1) 重要会计政策变更

适用 不适用

**(2)重要会计估计变更**
适用 不适用

**45. 其他**
适用 不适用

**(1) 一般风险准备金和交易风险准备金**

本公司按当年实现净利润的 10%分别计提一般风险准备和交易风险准备金。

**(2) 分部报告**

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，本公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

- 1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 2) 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

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

**(3) 终止经营的确认标准、会计处理方法**

满足下列条件之一的已被企业处置或被企业划归为持有待售的、在经营和编制财务报表时能够单独区分的组成部分确认为终止经营：

- 1) 该组成部分代表一项独立的主要业务或一个主要经营地区；
- 2) 该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个主要经营地区进行处置计划的一部分；
- 3) 该组成部分是仅仅为了再出售而取得的子公司。

本公司终止经营的情况见本财务报表附注其他重要事项之终止经营的说明。

**六、税项**
**1. 主要税种及税率**

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	应纳税营业额	6%
房产税	从价计征的，按房产原值一次减除 30%后余值的 1.2%计缴； 从租计征的，按租金收入的 12%计缴	1.2%或 12%

城市维护建设税	应缴流转税税额	7%或 5%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加	应缴流转税税额	1%或 2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、15%或 16.5%

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
重庆股份转让中心有限责任公司	15%
重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司	15%
重庆榆钱儿电子商务有限责任公司	15%
西南期货有限公司	15%
重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司	15%
西证股权投资有限公司	15%
西证国际证券股份有限公司	16.5%
除上述以外的其他纳税主体	25%

## 2. 税收优惠

适用 不适用

根据财政部海关总署国家税务总局《关于深入实施西部大开发战略有关税收政策问题的通知》（财税〔2011〕58号），自2011年1月1日至2020年12月31日，对设在西部地区的鼓励类产业企业减按15%的税率征收企业所得税。西证股权投资有限公司、重庆股份转让中心有限责任公司、重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司、重庆榆钱儿电子商务有限责任公司、西南期货有限公司和重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司2016年度暂按15%的税率计提企业所得税。

## 3. 其他

适用 不适用

## 七、合并财务报表项目注释

### 1. 货币资金

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：	/	/	187,825.51	/	/	177,139.83
人民币	/	/	22,436.16	/	/	19,282.11
港元	13,000.00	0.8945	11,628.50	13,000.00	0.8377	10,890.10
新加坡元	31,025.20	4.7995	148,905.45	31,067.07	4.5875	142,522.92
台币	22,510.00	0.2157	4,855.40	22,510.00	0.1975	4,444.70
银行存款：	/	/	17,271,393,287.49	/	/	21,987,586,498.31
其中：自有资金	/	/	6,093,765,895.31	/	/	5,117,190,468.51
人民币	/	/	5,453,800,385.44	/	/	4,619,257,134.50
美元	3,320,781.08	6.9370	23,036,258.35	2,654,248.13	6.4936	17,235,625.64
港元	689,564,522.07	0.8945	616,815,464.99	573,788,761.76	0.8377	480,662,845.73
澳元	6,085.34	5.0157	30,522.24	6,083.79	4.7403	28,838.95
欧元	636.77	7.3068	4,652.75	2.43	7.0988	17.25



英镑	4,177.66	8.5094	35,549.38	405.44	9.6235	3,901.75
加元	237.33	5.1406	1,220.02	134.01	4.6791	627.04
日元	679,848.00	0.0596	40,512.82	3,817.00	0.0539	205.82
新加坡元	276.97	4.7995	1,329.32	277.24	4.5875	1,271.83
客户资金	/	/	11,177,627,392.18	/	/	16,870,396,029.80
人民币	/	/	11,034,223,724.81	/	/	16,382,467,634.59
美元	13,998,011.92	6.9370	97,104,208.69	15,102,409.17	6.4936	98,069,004.19
港元	51,760,155.04	0.8945	46,299,458.68	465,392,611.93	0.8377	389,859,391.02
其他货币资金:	/	/	856,374,058.10	/	/	217,295,888.61
人民币	/	/	806,015,652.26	/	/	128,703,946.27
港元	56,297,826.53	0.8945	50,358,405.84	105,756,168.48	0.8377	88,591,942.34
合计	/	/	18,127,955,171.10	/	/	22,205,059,526.75

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	/	/		/	/	
人民币	/	/	9,572,207.39	/	/	48,767,475.50
客户信用资金	/	/		/	/	
人民币	/	/	1,338,023,177.21	/	/	2,151,606,081.16

货币资金的说明

适用  不适用

## 2. 结算备付金

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
自有备付金:	/	/	561,082,995.98	/	/	972,600,037.55
人民币	/	/	561,082,995.98	/	/	972,600,037.55
客户备付金:	/	/	2,576,488,781.45	/	/	2,521,249,062.73
人民币	/	/	2,547,551,494.69	/	/	2,478,113,587.25
美元	3,239,496.77	6.9370	22,472,389.09	3,871,683.32	6.4936	25,141,162.81
港元	7,227,386.99	0.8945	6,464,897.67	21,480,616.78	0.8377	17,994,312.67
信用备付金:	/	/	454,539,377.44	/	/	879,895,176.05
人民币	/	/	454,539,377.44	/	/	879,895,176.05
合计	/	/	3,592,111,154.87	/	/	4,373,744,276.33

## 3. 融出资金

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
个人	7,824,064,184.38	9,397,126,107.53
机构	233,480,856.71	730,425,470.13
小计	8,057,545,041.09	10,127,551,577.66
减：减值准备	15,683,006.05	18,963,867.75
合计	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	508,331,078.50	2,191,263,972.99
股票	20,987,933,671.34	32,532,464,614.61
合计	21,496,264,749.84	34,723,728,587.60

融出资金的说明

√适用 □不适用

**(1) 按类别明细情况**

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
融资融券业务融出资金	8,057,545,041.09	10,127,551,577.66
减：减值准备	15,683,006.05	18,963,867.75
合计	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91

**(2) 按剩余到期日分析**

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1-3个月	361,477,697.49	4.49	292,158.72	0.08
3-6个月	5,533,677,655.83	68.68	11,066,531.94	0.20
6个月以上	2,162,389,687.77	26.83	4,324,315.39	0.20
合计	8,057,545,041.09	100.00	15,683,006.05	0.19

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1-3个月	1,714,864,323.83	16.93	2,197,978.03	0.13
3-6个月	8,372,153,363.36	82.67	16,684,827.39	0.20
6个月以上	40,533,890.47	0.40	81,062.33	0.20
合计	10,127,551,577.66	100.00	18,963,867.75	0.19

**4. 拆出资金**

□适用 √不适用

**5. 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

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	15,292,890,714.97		15,292,890,714.97	15,198,481,002.94		15,198,481,002.94
基金	3,739,203,029.70		3,739,203,029.70	3,750,862,047.52		3,750,862,047.52

股票	2,502,246,008.00		2,502,246,008.00	2,572,869,733.76		2,572,869,733.76
合计	21,534,339,752.67		21,534,339,752.67	21,522,212,784.22		21,522,212,784.22
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	10,066,748,942.54		10,066,748,942.54	9,784,436,566.15		9,784,436,566.15
基金	3,050,305,798.80		3,050,305,798.80	3,060,772,828.67		3,060,772,828.67
股票	3,259,674,142.73		3,259,674,142.73	3,300,307,660.16		3,300,307,660.16
合计	16,376,728,884.07		16,376,728,884.07	16,145,517,054.98		16,145,517,054.98

#### 其他说明

变现有限制的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产详见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 76、所有权或使用权受到限制的资产”。

#### 6. 融券业务情况

√适用□不适用

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	9,464,229.21	56,572,917.71
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,836,229.21	56,572,917.71
—转融通融入证券	7,628,000.00	
转融通融入证券总额	7,628,000.00	

**7. 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)				3,000,000,000.00		12,180,889.30				49,000,000,000.00		68,475,239.58
利率互换				3,000,000,000.00		12,180,889.30				49,000,000,000.00		68,475,239.58
货币衍生工具 (按类别列示)	1,500,000,000.00	5,233,962.80	167,477,025.71				1,600,000,000.00	503,058.95	85,553,643.41			
货币互换	1,500,000,000.00	5,233,962.80	167,477,025.71				1,500,000,000.00		85,553,643.41			
远期外汇							100,000,000.00	503,058.95				
权益衍生工具 (按类别列示)				384,288.51	192,100.05					247,129,500.00		10,681,446.00
股票期权				384,288.51	192,100.05					247,129,500.00		10,681,446.00
其他衍生工具 (按类别列示)				68,400,000.00	25,578.62	9,040.87				144,363,300.00	99,640.00	
合计	1,500,000,000.00	5,233,962.80	167,477,025.71	3,068,784,288.51	217,678.67	12,189,930.17	1,600,000,000.00	503,058.95	85,553,643.41	49,391,492,800.00	99,640.00	79,156,685.58

**8. 买入返售金融资产**
**(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
股票	1,760,323,442.35	556,710,244.97
债券	1,192,468,140.48	769,027,090.09
减：减值准备	7,382,077.17	2,403,335.22
买入返售金融资产账面价值	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84

**(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	116,519,007.00	34,108,747.92
一个月至三个月内	76,800,006.00	150,178,508.90
三个月至一年内	722,940,429.35	343,422,988.15
一年以上	614,064,000.00	29,000,000.00
合计	1,530,323,442.35	556,710,244.97

买入返售金融资产的说明：

√适用 □不适用

**1) 按交易对手明细表**

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
银行金融机构		33,327,213.11
非银行金融机构	1,010,965,865.47	
其他	1,941,825,717.36	1,292,410,121.95
减：减值准备	7,382,077.17	2,403,335.22
合计	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84

**2) 按业务类型明细表**

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
约定购回式证券	134,770,017.00	190,108,005.00
股票质押式回购	1,395,553,425.35	366,602,239.97
普通回购	1,422,468,140.48	769,027,090.09
合计	2,952,791,582.83	1,325,737,335.06

**3) 担保物情况**

单位：元 币种：人民币

项目	收取担保物价值
约定回购	284,286,808.56
质押式回购	3,924,183,333.86
普通回购	1,413,651,525.00
合计	5,622,121,667.42

**9. 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	168,397,902.90	969,335,262.08
应收资产管理费	29,369,100.34	1,506,683.62
合计	197,767,003.24	970,841,945.70
减：减值准备		204,224.72
应收款项账面价值	197,767,003.24	970,637,720.98

**(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					1,506,683.62	100.00	75,334.18	5.00
合计					1,506,683.62	100.00	75,334.18	5.00

**(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					128,890.54	0.01	128,890.54	100.00
组合计提减值准备	197,767,003.24	100.00			970,713,055.16	99.99	75,334.18	0.01
合计	197,767,003.24	100.00			970,841,945.70	100.00	204,224.72	0.02

**10. 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	425,306,059.67	202,044,030.72
存放金融同业	1,981,394.62	20,681,042.46
融资融券	100,555,560.19	145,439,392.56
买入返售	9,996,484.40	14,016,838.95
委托贷款		20,524,000.00
其他	1,059,152.89	12,157,874.87
合计	538,898,651.77	414,863,179.56

**11. 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	182,612,422.79	818,559,670.77
信用保证金	1,115,057.40	1,698,978.17
履约保证金	238,075,890.28	121,949,808.00
期货保证金	198,197,325.60	51,035,044.00
股票期权保证金	5,158,061.90	5,073,975.97
合计	625,158,757.97	998,317,476.91

存出保证金的说明：

存出保证金——外币保证金

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
交易保证金：						
其中：美元	270,000.00	6.9370	1,872,990.00	270,000.00	6.4936	1,753,272.00
港币	4,868,720.64	0.8945	4,355,070.61	5,887,818.73	0.8377	4,932,225.75
小 计			6,228,060.61			6,685,497.75
信用保证金：						
其中：美元	160,740.58	6.9370	1,115,057.40	261,638.87	6.4936	1,698,978.17
小 计			1,115,057.40			1,698,978.17
履约保证金：						
其中：美元	34,319,718.94	6.9370	238,075,890.29	18,780,000.00	6.4936	121,949,808.00
小 计			238,075,890.29			121,949,808.00
合 计			245,419,008.30			130,334,283.92

**12. 应收股利****(1) 应收股利**

□适用 √不适用

**(2) 重要的账龄超过 1 年的应收股利：**

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**13. 划分为持有待售的资产**

□适用 √不适用

**14. 可供出售金融资产****(1) 明细情况**

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末数			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	2,726,802,527.94	63,532,325.38		2,790,334,853.32
可供出售权益工具	9,003,646,624.16	-75,656,479.70	85,532,157.96	8,842,457,986.50
合 计	11,730,449,152.10	-12,124,154.32	85,532,157.96	11,632,792,839.82

(续上表)

项目名称	期初数
------	-----

	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	1,848,269,891.45	15,497,853.54		1,863,767,744.99
可供出售权益工具	8,056,817,769.70	262,133,479.23	13,107,875.83	8,305,843,373.10
合计	9,905,087,661.15	277,631,332.77	13,107,875.83	10,169,611,118.09

注：期末可供出售金融资产中包括本公司投资于中国证券金融股份有限公司(以下简称证金公司)设立的专户投资。根据本公司与证金公司签订的相关合同，本公司分别于2015年7月、9月出资210,000.00万元、150,651.00万元。截至2016年12月31日，该投资账面价值为343,938.92万元。



**(2) 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	812,419,042.70	-995,282.40		811,423,760.30	510,972,533.40	5,050,576.60		516,023,110.00
基金	3,606,854,238.44	-167,108,073.00		3,439,746,165.44	3,863,571,765.10	-146,417,054.01		3,717,154,711.09
股票	3,175,769,853.72	32,252,668.42	71,684,676.85	3,136,337,845.29	2,609,495,193.39	357,936,379.83		2,967,431,573.22
证券公司理财产品	1,767,871,163.30	123,726,532.66		1,891,597,695.96	1,244,218,288.94	53,389,108.86		1,297,607,397.80
银行理财产品	966,000,000.00			966,000,000.00	416,050,000.00			416,050,000.00
其他	1,401,534,853.94		13,847,481.11	1,387,687,372.83	1,260,779,880.32	7,672,321.49	13,107,875.83	1,255,344,325.98
合计	11,730,449,152.10	-12,124,154.32	85,532,157.96	11,632,792,839.82	9,905,087,661.15	277,631,332.77	13,107,875.83	10,169,611,118.09

可供出售金融资产的说明

□适用 √不适用

(3) 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	8,233,591,770.22	2,726,802,527.94	10,960,394,298.16
公允价值	8,086,250,613.67	2,790,334,853.32	10,876,585,466.99
累计计入其他综合收益 的公允价值变动金额	-56,742,359.77	47,313,274.12	-9,429,085.65
已计提减值金额	71,684,676.85		71,684,676.85

(4) 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	合计
期初已计提减值金额	13,107,875.83	13,107,875.83
本年计提	72,424,282.13	72,424,282.13
其中：从其他综合收益转入	72,424,282.13	72,424,282.13
本年减少		
其中：期后公允价值回升转回	/	
期末已计提减值金额	85,532,157.96	85,532,157.96

(5) 其他

√适用 □不适用

1) 期末按成本计量的可供出售权益工具

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
成本计量的可供出售权益工具	756,207,372.83	662,569,104.64
合计	756,207,372.83	662,569,104.64

2) 所有权或使用权受到限制可供出售金融资产

所有权或使用权受到限制可供出售金融资产详见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 76、所有权或使用权受到限制的资产”。

15. 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	99,441,565.00	98,806,715.00	98,322,847.39
其中（按类别列示）：			
可转股债券		194,795,407.20	
持有至到期投资合计	99,441,565.00	293,602,122.20	98,322,847.39
减：持有至到期投资减值准备			
持有至到期投资账面价值	99,441,565.00	293,602,122.20	98,322,847.39

持有至到期投资的说明：

适用  不适用

**期末重要的持有至到期投资**

项 目	面值	票面利率	实际利率	到期日
海航持有至到期日债券	RMB100,000,000	9.25%	9.25%	2017年8月

**16. 长期应收款**

(1) 长期应收款情况：

适用  不适用

(2) 因金融资产转移而终止确认的长期应收款

适用  不适用

(3) 转移长期应收款且继续涉入形成的资产、负债金额

适用  不适用

其他说明

适用  不适用

**17. 长期股权投资**

适用  不适用

(1) 分类情况

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	1,853,356,277.03	231,392,084.48	1,621,964,192.55
合 计	1,853,356,277.03	231,392,084.48	1,621,964,192.55

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	1,886,609,928.48	231,392,084.48	1,655,217,844.00
合 计	1,886,609,928.48	231,392,084.48	1,655,217,844.00

**(2) 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
		减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	宣告发放现金股利或利润		
一、合营企业							
小计							
二、联营企业							
银华基金管理股份有限公司	1,625,817,844.00		151,874,016.03	585,467.50	156,313,134.98	1,621,964,192.55	231,392,084.48
武汉广德股权投资基金合伙企业（有限合伙）	18,500,000.00	18,500,000.00					
珠海西证汇盈股权投资基金合伙企业（有限合伙）	10,500,000.00	10,500,000.00					
四川省川机天成股权投资基金有限公司	400,000.00	400,000.00					
小计	1,655,217,844.00	29,400,000.00	151,874,016.03	585,467.50	156,313,134.98	1,621,964,192.55	231,392,084.48
合计	1,655,217,844.00	29,400,000.00	151,874,016.03	585,467.50	156,313,134.98	1,621,964,192.55	231,392,084.48

**其他说明**

注：公司于资产负债表日对持有的银华基金管理股份有限公司股权价值进行了减值测试，聘请开元资产评估有限公司进行了评估。评估机构按收益法评估银华基金管理股份有限公司股权价值，并出具了评估报告（开元评报字[2017]052号）。截至2016年12月31日，本公司所持银华基金管理股份有限公司股权评估价值高于当前持有的银华基金管理股份有限公司股权账面价值，故本期不计提减值。

**18. 投资性房地产**

投资性房地产计量模式

**(1) 采用成本计量模式的投资性房地产**

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	99,456,721.04	99,456,721.04
2. 本期增加金额		
3. 本期减少金额		
4. 期末余额	99,456,721.04	99,456,721.04
二、累计折旧和累计摊销		
1. 期初余额	45,785,346.55	45,785,346.55
2. 本期增加金额	3,487,348.42	3,487,348.42
(1) 计提或摊销	3,487,348.42	3,487,348.42
3. 本期减少金额		
4. 期末余额	49,272,694.97	49,272,694.97
三、减值准备		
1. 期初余额	7,491,322.43	7,491,322.43
2. 本期增加金额		
3. 本期减少金额		
4. 期末余额	7,491,322.43	7,491,322.43
四、账面价值		
1. 期末账面价值	42,692,703.64	42,692,703.64
2. 期初账面价值	46,180,052.06	46,180,052.06

**(2) 未办妥产权证书的投资性房地产情况：**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
房屋及建筑物	5,625,485.69	相关产权正在办理
小计	5,625,485.69	

其他说明

 适用  不适用

**19. 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	电子设备	机器设备	运输工具	办公设备	合计
一、账面原值：						
1. 期初余额	357,575,988.76	213,968,175.61	10,967,634.96	36,744,314.82	22,768,676.46	642,024,790.61
2. 本期增加金额	21,131,859.36	50,578,714.78	1,421,672.65	3,794,850.72	6,468,765.66	83,395,863.17
(1) 购置	21,131,859.36	50,578,714.78	1,421,672.65	3,794,850.72	6,468,765.66	83,395,863.17
3. 本期减少金额		3,689,813.63	1,915,165.85	1,091,877.00	1,165,464.36	7,862,320.84
(1) 处置或报废		3,689,813.63	1,915,165.85	1,091,877.00	1,165,464.36	7,862,320.84
4. 期末余额	378,707,848.12	260,857,076.76	10,474,141.76	39,447,288.54	28,071,977.76	717,558,332.94
二、累计折旧						
1. 期初余额	131,152,695.26	148,424,686.34	8,652,737.35	17,413,389.99	13,280,764.26	318,924,273.20
2. 本期增加金额	11,142,742.14	41,102,545.44	786,130.74	5,245,031.58	2,862,828.22	61,139,278.12

(1) 计提	11,142,742.14	41,102,545.44	786,130.74	5,245,031.58	2,862,828.22	61,139,278.12
3. 本期减少金额		2,726,970.78	594,071.72	1,067,266.89	570,792.32	4,959,101.71
(1) 处置或报废		2,726,970.78	594,071.72	1,067,266.89	570,792.32	4,959,101.71
4. 期末余额	142,295,437.40	186,800,261.00	8,844,796.37	21,591,154.68	15,572,800.16	375,104,449.61
三、减值准备						
1. 期初余额	7,125,166.62					7,125,166.62
2. 本期增加金额						
3. 本期减少金额						
4. 期末余额	7,125,166.62					7,125,166.62
四、账面价值						
1. 期末账面价值	229,287,244.10	74,056,815.76	1,629,345.39	17,856,133.86	12,499,177.60	335,328,716.71
2. 期初账面价值	219,298,126.88	65,543,489.27	2,314,897.61	19,330,924.83	9,487,912.20	315,975,350.79

**(2) 暂时闲置的固定资产情况**
 适用  不适用

**(3) 通过融资租赁租入的固定资产情况**
 适用  不适用

**(4) 通过经营租赁租出的固定资产**
 适用  不适用

**(5) 未办妥产权证书的固定资产情况**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**20. 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
江北嘴大楼	285,779,102.36		285,779,102.36	240,736,919.65		240,736,919.65
合计	285,779,102.36		285,779,102.36	240,736,919.65		240,736,919.65

**(2) 重要在建工程项目本期变动情况**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	预算数	期初余额	本期增加金额	期末余额	工程累计投入占 预算比例(%)	工程进 度(%)	资金来源
江北嘴大楼	1,130,000,000.00	240,736,919.65	45,042,182.71	285,779,102.36	25.29	25.29	自有资金
合计	1,130,000,000.00	240,736,919.65	45,042,182.71	285,779,102.36	/	/	/

**(3) 本期计提在建工程减值准备情况：**
 适用  不适用

其他说明

适用  不适用

## 21. 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	其他	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	158,578,919.84	101,773,183.30	8,415,192.19	1,400,000.00	270,167,295.33
2. 本期增加金额		44,835,997.39	40,432.68		44,876,430.07
(1) 购置		44,835,997.39	40,432.68		44,876,430.07
3. 本期减少金额		37,393.17			37,393.17
(1) 处置		37,393.17			37,393.17
4. 期末余额	158,578,919.84	146,571,787.52	8,455,624.87	1,400,000.00	315,006,332.23
二、累计摊销					
1. 期初余额	22,367,974.09	62,917,217.10	8,415,192.19		93,700,383.38
2. 本期增加金额	4,006,204.32	22,563,616.25	40,432.68		26,610,253.25
(1) 计提	4,006,204.32	22,563,616.25	40,432.68		26,610,253.25
3. 本期减少金额		2,111.03			2,111.03
(1) 处置		2,111.03			2,111.03
4. 期末余额	26,374,178.41	85,478,722.32	8,455,624.87		120,308,525.60
三、减值准备					
1. 期初余额		363,171.94			363,171.94
2. 本期增加金额					
3. 本期减少金额					
4. 期末余额		363,171.94			363,171.94
四、账面价值					
1. 期末账面价值	132,204,741.43	60,729,893.26		1,400,000.00	194,334,634.69
2. 期初账面价值	136,210,945.75	38,492,794.26		1,400,000.00	176,103,740.01

### (2) 未办妥产权证书的土地使用权情况:

 适用  不适用

其他说明:

 适用  不适用

## 22. 开发支出

 适用  不适用

**23. 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		
西证国际证券股份有限公司	254,763,455.19		17,274,160.51			272,037,615.70
西南期货有限公司	40,620,597.75					40,620,597.75
合计	295,384,052.94		17,274,160.51			312,658,213.45

**(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	处置	
西南期货有限公司	29,597,900.00			29,597,900.00
合计	29,597,900.00			29,597,900.00

说明商誉减值测试过程、参数及商誉减值损失的确认方法

 适用  不适用

## 1) 西南期货有限公司

公司聘请开元资产评估有限公司对商誉可回收金额进行评估，评估机构按收益法评估西南期货有限公司股权价值，并出具了评估报告（开元评报字[2017]051号）。截至2016年12月31日，本公司所持西南期货有限公司股权评估价值高于当前持有的西南期货有限公司股权账面价值，故本期不计提商誉减值准备。

## 2) 西证国际证券股份有限公司

西证国际证券股份有限公司系香港主板上市企业，能够取得活跃股价，公司按照期末收盘价计算可回收金额高于账面价值，故未发生减值。

其他说明

 适用  不适用

**24. 长期待摊费用**
 适用  不适用

**25. 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	242,053,558.46	49,991,496.56	259,732,200.25	55,261,772.94
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动			79,156,685.58	19,789,171.40
计入其他综合收益的可供出	52,531,613.93	13,574,527.02	33,926,385.04	8,481,596.26



售金融资产公允价值变动				
应付职工薪酬	169,221,520.17	42,195,380.04	603,361,939.47	145,789,102.68
预计负债	64,180,032.69	16,045,008.17		
可抵扣亏损	16,438,885.30	4,109,721.33	2,018,870.11	504,717.53
结构化主体母公司承担亏损	160,030,578.39	35,404,579.09		
其他	5,344,548.91	801,942.58	5,501,916.52	825,287.47
合计	709,800,737.85	162,122,654.79	983,697,996.97	230,651,648.28

**(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
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	32,957,715.38	8,239,428.84	263,411,844.01	65,852,961.00
计入其他综合收益的可供出售金融资产公允价值变动			316,810,742.00	75,203,305.15
结构化主体母公司享有的利润			19,263,800.00	4,815,950.00
其他			30,167,338.75	7,541,834.69
合计	32,957,715.38	8,239,428.84	629,653,724.76	153,414,050.84

**(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

**(4) 未确认递延所得税资产明细**
 适用  不适用

**(5) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**26. 其他资产**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	327,840,956.19	484,450,330.30
应收股利	3,142,784.18	3,072,235.68
长期待摊费用	87,629,916.85	63,227,019.99
预付账款	114,421,311.49	157,539,678.49
委托贷款		780,000,000.00
发放贷款及垫款	135,351,665.33	65,638,298.61
预缴所得税	64,835,014.29	29,770,248.70
合计	733,221,648.33	1,583,697,811.77

其他资产的说明：

**(1) 其他应收款**

## 1) 明细情况

## ① 类别明细情况

单位：元 币种：人民币

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	247,822,500.00	48.15	108,782,250.00	43.90	139,040,250.00
按信用风险特征组合计提坏账准备					
其中：账龄组合	30,497,416.49	5.93	5,146,787.39	16.88	25,350,629.10
无收款风险组合	130,171,620.51	25.30			130,171,620.51
单项金额不重大并单项计提坏账准备	106,085,915.33	20.62	72,807,458.75	68.63	33,278,456.58
合计	514,577,452.33	100.00	186,736,496.14	36.29	327,840,956.19

(续上表)

种类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	465,903,039.35	67.80	161,026,964.08	34.56	304,876,075.27
按信用风险特征组合计提坏账准备					
其中：账龄组合	82,823,860.50	12.05	7,663,038.03	9.25	75,160,822.47
无收款风险组合	70,413,432.56	10.25			70,413,432.56
单项金额不重大并单项计提坏账准备	68,000,000.00	9.90	34,000,000.00	50.00	34,000,000.00
合计	687,140,332.41	100.00	202,690,002.11	29.50	484,450,330.30

## ② 期末单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

其他应收款内容	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
质押回购款	127,822,500.00	12,782,250.00	10.00	预计回款期限较长
应收投资款	120,000,000.00	96,000,000.00	80.00	款项收回非常困难
小计	247,822,500.00	108,782,250.00	43.90	

## ③ 组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1 年以内	20,310,954.04	66.60	1,015,547.70	5.00
1-2 年	3,602,713.96	11.81	360,271.40	10.00
2-3 年	2,188,780.44	7.18	656,634.13	30.00
3-4 年	2,521,052.66	8.27	1,260,526.33	50.00
4-5 年	100,537.81	0.33	80,430.25	80.00
5 年以上	1,773,377.58	5.81	1,773,377.58	100.00
小计	30,497,416.49	100.00	5,146,787.39	16.88

(续上表)

账龄	期初数			
----	-----	--	--	--

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	71,761,736.75	86.64	3,588,086.84	5.00
1-2 年	3,627,948.30	4.38	362,794.83	10.00
2-3 年	4,396,269.06	5.31	1,318,880.72	30.00
3-4 年	1,214,528.81	1.47	607,264.41	50.00
4-5 年	186,831.76	0.22	149,465.41	80.00
5 年以上	1,636,545.82	1.98	1,636,545.82	100.00
小 计	82,823,860.50	100.00	7,663,038.03	9.25

## 2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

① 本期计提坏账准备 61,086,983.39 元,收回前期核销款增加坏账准备 38,633,844.00 元,转回坏账准备 115,878,558.08 元。

## ② 本期重要的坏账准备收回或转回情况

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	收回金额	计提坏账准备金额	收回方式
三佳电子(集团)有限责任公司	141,988,889.00	14,198,888.90	现金收回
嘉实资本管理有限公司	76,091,650.35	38,045,825.18	现金收回
重庆渝宏公路工程(集团)有限责任公司	50,000,000.00	25,000,000.00	现金收回
上海中经投资管理有限公司	38,633,844.00	38,633,844.00	现金收回
小 计	306,714,383.35	115,878,558.08	

## 3) 其他应收款项性质分类情况

单位: 元 币种: 人民币

款项性质	期末数	期初数
押金保证金	67,672,302.96	21,515,528.71
拆借款	117,498,892.31	12,232,229.64
应收暂付款	62,910,159.09	78,635,558.12
投资款	120,000,000.00	120,000,000.00
股权认购款		48,720,000.00
股权质押回购款	127,822,500.00	269,811,389.00
逾期投资款		126,091,650.35
其他	18,673,597.97	10,133,976.59
其他应收款项合计	514,577,452.33	687,140,332.41
减: 其他应收款项减值准备	186,736,496.14	202,690,002.11
合 计	327,840,956.19	484,450,330.30

## 4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例 (%)	坏账准备
蔡开坚	股权质押回购款	127,822,500.00	1-2 年	24.84	12,782,250.00
河南富田畜牧发展有限公司	投资款	120,000,000.00	4-5 年	23.32	96,000,000.00
短欠融资客户#M809619	拆借款	28,159,305.87	1 年以内	5.47	20,049,233.55
短欠融资客户#M811500	拆借款	27,780,278.05	1 年以内	5.40	16,306,437.13
盈透证券	应收暂付款	26,847,709.45	1 年以内	5.22	

小 计		330,609,793.37		64.25	145,137,920.68
-----	--	----------------	--	-------	----------------

**(2) 应收股利**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数	未收回的原因	相关款项是否发生减值
账龄 1 年以内	3,142,784.18	3,072,235.68		
其中：				
基金、股票红利	3,142,784.18	3,072,235.68	宣告但尚未发放	否
合 计	3,142,784.18	3,072,235.68		

**(3) 长期待摊费用**

单位：元 币种：人民币

项 目	期初数	本期增加	本期摊销	期末数
固定资产改良	33,832,417.55	35,559,088.36	17,647,310.48	51,744,195.43
网络工程	5,036,456.61	5,072,370.38	3,791,096.04	6,317,730.95
其 他	24,358,145.83	21,422,739.90	16,212,895.26	29,567,990.47
合 计	63,227,019.99	62,054,198.64	37,651,301.78	87,629,916.85

**(4) 预付账款**

## 1) 账龄分析

单位：元 币种：人民币

账 龄	期末数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	57,983,401.67	50.67		57,983,401.67
1-2 年	41,153,220.09	35.97		41,153,220.09
2-3 年	15,284,689.73	13.36		15,284,689.73
合 计	114,421,311.49	100.00		114,421,311.49

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	139,001,495.45	88.23		139,001,495.45
1-2 年	18,538,183.04	11.77		18,538,183.04
合 计	157,539,678.49	100.00		157,539,678.49

## 2) 预付账款金额前 5 名情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	款项性质	账面余额	占预付款项余额的比例 (%)
重庆泰正(集团)有限公司	购房款	24,777,940.00	21.66
重庆龙湖嘉凯地产开发有限公司	购房款	22,971,200.88	20.08
恒生电子股份有限公司	业务平台采购款	4,642,735.05	4.06
重庆云城两山投资开发有限公司	购房款	3,796,062.00	3.32
Epoch Market	采购款	2,978,685.00	2.60
小 计		59,166,622.93	51.72

**(5) 委托贷款**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
重庆泰耀置业有限公司		780,000,000.00
委托贷款合计		780,000,000.00
减：减值准备		
合 计		780,000,000.00

**(6) 发放贷款及垫款**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
贷款	151,546,765.33	84,058,298.61
发放贷款及垫款合计	151,546,765.33	84,058,298.61
减：减值准备	16,195,100.00	18,420,000.00
合 计	135,351,665.33	65,638,298.61

**27. 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	
买入返售金融资产减值准备	2,403,335.22	4,978,741.95		7,382,077.17
坏账准备	202,894,226.83	99,720,827.39	115,878,558.08	186,736,496.14
可供出售金融资产减值准备	13,107,875.83	72,424,282.13		85,532,157.96
长期股权投资减值准备	231,392,084.48			231,392,084.48
投资性房地产减值准备	7,491,322.43			7,491,322.43
固定资产减值准备	7,125,166.62			7,125,166.62
无形资产减值准备	363,171.94			363,171.94
商誉减值准备	29,597,900.00			29,597,900.00
贷款及委托贷款减值准备	18,420,000.00		2,224,900.00	16,195,100.00
融资融券减值准备	18,963,867.75		3,262,055.01	15,701,812.74
合 计	531,758,951.10	177,123,851.47	121,365,513.09	587,517,289.48

**28. 短期借款**
**(1) 短期借款分类**
 适用  不适用

**(2) 已逾期未偿还的短期借款情况**
 适用  不适用

其他说明

 适用  不适用

**29. 应付短期融资款**

单位：元 币种：人民币

项 目	面值	发行日期	债券期限(天)	发行金额	票面利率(%)
西南证券收益凭证聚金[2015030]	300,000,000.00	2015/10/28	156 天	300,000,000.00	5.50%
16 西南 D1	1,500,000,000.00	2016/1/18	90 天	1,500,000,000.00	3.00%
16 西南 D2	1,500,000,000.00	2016/1/18	180 天	1,500,000,000.00	3.00%
16 西南 D3	1,500,000,000.00	2016/1/19	270 天	1,500,000,000.00	3.10%
16 西南 D4	3,000,000,000.00	2016/4/12	270 天	3,000,000,000.00	3.15%
16 西南 D5	4,000,000,000.00	2016/12/16	270 天	4,000,000,000.00	4.80%

15 西南 01	1,000,000,000.00	2015/1/9	1 年	1,000,000,000.00	5.70%
西南证券收益凭证聚金[2016001]	200,000,000.00	2016/3/14	91 天	200,000,000.00	5.20%
西南证券收益凭证聚金[2016002]	300,000,000.00	2016/12/29	90 天	300,000,000.00	4.20%
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'3 号	25,000,000.00	2016/12/9	30 天	25,000,000.00	
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'4 号	25,000,000.00	2016/12/9	30 天	25,000,000.00	
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'1 号	18,400,000.00	2016/12/23	178 天	18,400,000.00	
小 计	13,368,400,000.00			13,368,400,000.00	

(续上表)

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
西南证券收益凭证聚金[2015030]	300,000,000.00		300,000,000.00	
16 西南 D1		1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	
16 西南 D2		1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	
16 西南 D3		1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	
16 西南 D4		3,000,000,000.00		3,000,000,000.00
16 西南 D5		4,000,000,000.00		4,000,000,000.00
15 西南 01	1,000,000,000.00		1,000,000,000.00	
西南证券收益凭证聚金[2016001]		200,000,000.00	200,000,000.00	
西南证券收益凭证聚金[2016002]		300,000,000.00		300,000,000.00
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'3 号		25,000,000.00		25,000,000.00
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'4 号		25,000,000.00		25,000,000.00
西南证券中证 500 指数浮动收益凭证'聚鑫'1 号		18,400,000.00		18,400,000.00
小 计	1,300,000,000.00	12,068,400,000.00	6,000,000,000.00	7,368,400,000.00

### 30. 拆入资金

√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
转融通融入款项		885,000,000.00
合计		885,000,000.00

### 31. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			期初公允价值		
	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
股票	7,628,000.00		7,628,000.00	32,710,193.02		32,710,193.02
第三方在结构化主体中享有的权益		5,482,862,745.17	5,482,862,745.17		3,739,942,896.23	3,739,942,896.23
合计	7,628,000.00	5,482,862,745.17	5,490,490,745.17	32,710,193.02	3,739,942,896.23	3,772,653,089.25

### 32. 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	6,780,845,721.37	5,381,801,349.72

其他	2,900,000,000.00	4,950,000,000.00
合计	9,680,845,721.37	10,331,801,349.72

**(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	38,934,000.00	2.00-3.00	70,293,000.00	2.50-4.00
一个月至三个月内	100,000.00		100,000.00	
三个月至一年内				
一年以上				
合计	39,034,000.00		70,393,000.00	

卖出回购金融资产款的说明：

√适用 □不适用

**(1) 按业务类型明细表**

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
债券质押式报价回购	39,034,000.00	70,393,000.00
其他卖出回购金融资产款	9,641,811,721.37	10,261,408,349.72
合计	9,680,845,721.37	10,331,801,349.72

**(2) 按交易对手明细表**

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
银行	573,414,056.16	2,284,507,841.52
非银行金融机构	9,107,431,665.21	8,047,293,508.20
合计	9,680,845,721.37	10,331,801,349.72

**(3) 卖出回购金融资产担保物期末公允价值**

公司卖出回购金融资产担保物期末公允价值为 9,954,406,280.23 元。

**33. 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
普通经纪业务	12,015,694,592.94	16,873,595,213.99
其中：个人	10,202,676,575.15	14,129,018,688.04
机构	1,813,018,017.79	2,744,576,525.95
信用业务	1,276,432,930.70	2,191,263,972.99
其中：个人	1,223,029,534.17	2,117,818,584.56
机构	53,403,396.53	73,445,388.43
合计	13,292,127,523.64	19,064,859,186.98

代理买卖证券款的说明：

**代理买卖证券款——外币款项**

单位：元 币种：人民币

币种	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	折人民币金额	原币金额	汇率	折人民币金额

港币	51,688,329.13	0.8945	46,235,210.41	481,194,996.76	0.8377	403,097,048.79
美元	16,534,738.99	6.9370	114,701,484.37	17,803,398.21	6.4936	115,608,146.62
小计			160,936,694.78			518,705,195.41

**34. 代理承销证券款**
 适用  不适用

**35. 信用交易代理买卖证券款**
 适用  不适用

**36. 衍生金融负债**
 适用  不适用

**37. 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	137,729,419.02	654,044,577.41
应付手续费及佣金	153,092.92	417,113.07
应付托管费	1,672,565.17	1,650,660.28
其他	60,183.25	
合计	139,615,260.36	656,112,350.76

其他说明

 适用  不适用

**38. 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	1,448,195,697.10	1,636,161,560.59	2,112,576,840.65	971,780,417.04
二、离职后福利— 设定提存计划	3,900,878.03	82,597,801.21	83,429,719.35	3,068,959.89
三、辞退福利	1,700,418.49	130,560.44	824,164.72	1,006,814.21
四、离职后福利— 设定受益计划	22,971,604.44	2,789,017.75	1,435,344.96	24,325,277.23
合计	1,476,768,598.06	1,721,678,939.99	2,198,266,069.68	1,000,181,468.37

**(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	1,436,007,908.79	1,513,733,266.78	1,992,385,630.27	957,355,545.30
二、职工福利费		17,938,843.65	17,922,927.96	15,915.69



三、社会保险费	1,392,300.72	41,787,786.15	41,569,709.04	1,610,377.83
其中：医疗保险费	556,171.72	38,075,766.06	38,308,453.03	323,484.75
工伤保险费	38,494.47	1,364,024.56	1,369,261.19	33,257.84
生育保险费	797,634.53	2,347,995.53	1,891,994.82	1,253,635.24
四、住房公积金	655,394.67	46,015,996.45	46,531,247.03	140,144.09
五、工会经费和职工教育经费	9,954,809.85	16,685,667.56	13,982,043.28	12,658,434.13
六、短期带薪缺勤	185,283.07		185,283.07	
合计	1,448,195,697.10	1,636,161,560.59	2,112,576,840.65	971,780,417.04

### (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	2,042,022.48	71,853,311.61	72,154,085.37	1,741,248.72
2、失业保险费	433,242.28	3,017,079.01	2,993,824.53	456,496.76
3、企业年金缴费	1,425,613.27	7,727,410.59	8,281,809.45	871,214.41
合计	3,900,878.03	82,597,801.21	83,429,719.35	3,068,959.89

其他说明：

√适用 □不适用

### 设定受益计划变动情况

#### 1) 设定受益计划义务现值

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	22,971,604.44
计入当期综合收益的设定受益成本	2,789,017.75
① 利息净额	846,113.11
② 重新计量变动	1,942,904.64
其他变动	-1,435,344.96
① 已支付的福利	-1,435,344.96
期末余额	24,325,277.23

#### 2) 设定受益计划净负债

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	22,971,604.44
计入当期损益的设定受益成本	846,113.11
计入其他综合收益的设定受益成本	1,942,904.64
其他变动	-1,435,344.96
期末余额	24,325,277.23

#### 3) 设定受益计划的内容

公司为 2013 年 1 月 1 日之前退休的职工提供以下补充退休后福利：养老金低于社平工资的人员，补足社平工资再每月每人增加 500 元补贴；养老金高于社平工资的人员，每月每人增加 800 元补贴。

#### 4) 设定受益计划重大精算假设

精算假设条件中，折现率为3.6203%，社平工资增长率区分重庆地区和深圳地区情况，设置为8.22%—4.5%，重庆地区人均预期寿命男性为75.09岁，女性为80.90岁，深圳地区人均预期寿命男性为76.50岁，女性为81.50岁。

### 39. 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	12,140,423.94	13,820.76
营业税		58,181,785.93
企业所得税	13,009,265.59	202,637,229.30
个人所得税	114,387,883.14	62,881,048.38
城市维护建设税	1,081,342.43	3,987,223.80
教育费附加	473,480.25	1,720,569.81
地方教育附加	290,610.23	1,126,595.44
投资者保障基金	20,500,038.79	20,135,076.48
其他	1,825,340.14	75,298.91
合计	163,708,384.51	350,758,648.81

### 40. 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
拆入资金		24,825,500.00
其中：转融通融入资金		24,825,500.00
应付短期融资款	74,930,136.99	57,752,054.80
应付债券	226,954,027.80	237,960,701.17
卖出回购	39,271,647.69	72,724,244.66
其他		17,267,070.10
合计	341,155,812.48	410,529,570.73

### 41. 划分为持有待售的负债

适用  不适用

### 42. 长期借款

#### (1) 长期借款分类

适用  不适用

其他说明，包括利率区间：

适用  不适用

### 43. 应付债券

适用  不适用

#### (1) 明细情况

单位：元 币种：人民币

债券类型	期末余额	期初余额
次级债	6,000,000,000.00	3,000,000,000.00
公司债	7,447,553,351.21	7,414,977,017.90
固定收益凭证		2,300,000,000.00
合计	13,447,553,351.21	12,714,977,017.90

**(2) 应付债券增减变动**

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
14 西南 01 债	4,000,000,000.00	2015/6/10	3 年	4,000,000,000.00	4.10%	3,977,911,249.64	3,963,853,741.11
14 西南 02 债	2,000,000,000.00	2015/7/23	5 年	2,000,000,000.00	3.67%	1,985,525,917.83	1,981,695,452.06
14 西南债	3,000,000,000.00	2014/10/5	5 年	3,000,000,000.00	5.88%		3,000,000,000.00
16 西南 C1	3,000,000,000.00	2016/6/2	5 年	3,000,000,000.00	3.63%	3,000,000,000.00	
16 西南 C2	3,000,000,000.00	2016/9/20	3 年	3,000,000,000.00	3.49%	3,000,000,000.00	
上交所公司债	1,500,000,000.00	2015/5/29	3 年	1,476,210,799.35	3.89%	1,484,116,183.74	1,469,427,824.73
西南证券收益凭证聚金[2015020]	700,000,000.00	2015/4/17	540 天	700,000,000.00	6.50%		700,000,000.00
西南证券收益凭证聚金[2015021]	300,000,000.00	2015/4/22	546 天	300,000,000.00	6.30%		300,000,000.00
西南证券收益凭证聚金[2015022]	500,000,000.00	2015/5/11	548 天	500,000,000.00	6.30%		500,000,000.00
西南证券收益凭证聚金[2015027]	500,000,000.00	2015/5/26	541 天	500,000,000.00	6.10%		500,000,000.00
西南证券收益凭证聚金[2015028]	300,000,000.00	2015/5/27	540 天	300,000,000.00	6.10%		300,000,000.00
小 计	18,800,000,000.00			18,776,210,799.35		13,447,553,351.21	12,714,977,017.90

**44. 长期应付款**
**(1) 按款项性质列示长期应付款：**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**45. 长期应付职工薪酬**
 适用  不适用

**46. 专项应付款**
 适用  不适用

**47. 预计负债**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	期末余额	形成原因
诉讼赔偿		64,180,032.69	
合计		64,180,032.69	/

其他说明，包括重要预计负债的相关重要假设、估计说明：

预计负债系新华证券诉公司擅自处置委托股票案相关的预计赔偿支出, 详见本年度报告“第十一节 财务报告 十七、资产负债表日后事项 4、其他资产负债表日后事项说明”。

#### 48. 递延收益

递延收益情况

适用 不适用

涉及政府补助的项目:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

#### 49. 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
应付股利	32,694,637.61	50,578,714.61
其他应付款	106,378,556.68	817,591,002.23
代理兑付债券款	511,638.50	511,638.50
预收款项	6,669,507.52	249,570.06
期货风险准备金	8,348,056.42	7,212,299.26
递延收益	1,140,992.76	1,571,672.76
合计	155,743,389.49	877,714,897.42

其他负债的说明:

##### (1) 应付股利

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	期末数	期初数	超过1年未支付原因
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	32,694,637.61	22,500,000.00	股利领取相关事宜正在办理中
重庆长江水运股份有限公司		5,326,065.00	
海南珠江控股股份有限公司		18,287,488.59	
重庆市城市交通开发投资(集团)有限公司		4,465,161.02	
合计	32,694,637.61	50,578,714.61	

##### (2) 其他应付款

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末数	期初数
押金保证金	54,566,237.33	57,343,295.73
拆借款		8,745,389.78
应付暂收款	14,327,799.63	38,817,138.02
信息系统及设备尾款	4,973,072.53	3,764,253.86
其他	32,511,447.19	708,920,924.84
合计	106,378,556.68	817,591,002.23

**(3)代理兑付债券款**

单位：元 币种：人民币

项 目	期初数	本期收到兑付资金	本期已兑付债券	本期结转手续费收入	期末数
企业债券	511,638.50				511,638.50
合 计	511,638.50				511,638.50

**(4)预收款项**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
预收财务顾问费	6,650,000.00	
其他	19,507.52	249,570.06
合 计	6,669,507.52	249,570.06

**(5)递延收益**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
政府补助	1,140,992.76	1,571,672.76
合 计	1,140,992.76	1,571,672.76

**50. 次级债券**
适用 不适用

**51. 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	5,645,109,124.00						5,645,109,124.00

**52. 其他权益工具**
**(1) 期末发行在外的优先股、永续债等其他金融工具基本情况**
适用 不适用

**(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表**
适用 不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**53. 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）	7,455,313,014.10			7,455,313,014.10
其他资本公积	396,754,943.96			396,754,943.96
合计	7,852,067,958.06			7,852,067,958.06

#### 54. 库存股

适用 不适用

#### 55. 其他综合收益

适用 不适用

##### (1) 资产负债表中其他综合收益累计余额

单位：元 币种：人民币

项目	期初数	本期发生额					期末数
		本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
以后不能重分类进损益的其他综合收益	-5,679,202.00	-1,942,904.64			-1,942,904.64		-7,622,106.64
其中：重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动	-5,679,202.00	-1,942,904.64			-1,942,904.64		-7,622,106.64
以后将重分类进损益的其他综合收益	248,386,342.38	-54,239,191.06	130,680,833.47	-7,543,133.04	-198,229,541.32	20,852,649.83	50,156,801.06
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	652,004.55	585,467.50			585,467.50		1,237,472.05
可供出售金融资产公允价值变动损益	191,643,381.23	-43,298,688.12	130,680,833.47	6,120,341.63	-201,072,466.88	20,972,603.66	-9,429,085.65
外币财务报表折算差额	20,983,597.21	43,127,928.25			43,247,882.08	-119,953.83	64,231,479.29
其他	35,107,359.39	-54,653,898.69		-13,663,474.67	-40,990,424.02		-5,883,064.63
合计	242,707,140.38	-56,182,095.70	130,680,833.47	-7,543,133.04	-200,172,445.96	20,852,649.83	42,534,694.42

##### (2) 利润表中其他综合收益当期发生额

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	-43,298,688.12	257,361,889.13
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	6,120,341.63	65,146,679.02
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	130,680,833.47	682,463,151.99
小计	-180,099,863.22	-490,247,941.88
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	585,467.50	652,004.55
小计	585,467.50	652,004.55
3. 重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动	-1,942,904.64	-5,679,202.00
小计	-1,942,904.64	-5,679,202.00
4. 外币财务报表折算差额	43,127,928.25	22,150,709.46
小计	43,127,928.25	22,150,709.46
5. 其他	-54,653,898.69	45,368,306.92
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响	-13,663,474.67	10,260,947.53
小计	-40,990,424.02	35,107,359.39
合计	-179,319,796.13	-438,017,070.48

**56. 专项储备**
 适用  不适用

**57. 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	827,228,843.10	98,900,463.55		926,129,306.65
合计	827,228,843.10	98,900,463.55		926,129,306.65

**58. 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	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	788,738,848.90	98,900,463.55			887,639,312.45
交易风险准备	788,738,848.90	98,900,463.55			887,639,312.45
合计	1,577,477,697.80	197,800,927.10			1,775,278,624.90

**59. 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	2,873,145,282.45	1,129,910,541.29
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	2,873,145,282.45	1,129,910,541.29
加：本期归属于母公司所有者的净利润	917,572,729.00	3,554,650,541.89
减：提取法定盈余公积	98,900,463.55	321,549,810.71
提取一般风险准备	197,800,927.10	643,099,621.42
应付普通股股利	733,864,186.12	846,766,368.60
期末未分配利润	2,760,152,434.68	2,873,145,282.45

**60. 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	2,959,427,458.43	5,221,287,523.96
证券经纪业务	1,152,740,448.51	2,809,067,172.01
其中：代理买卖证券业务	1,005,350,082.67	2,631,068,464.90
交易单元席位租赁	124,200,773.14	132,339,122.99
代销金融产品业务	23,189,592.70	45,659,584.12
期货经纪业务	24,426,746.44	21,966,060.02

投资银行业务	1,567,244,387.33	1,637,470,181.86
其中：证券承销业务	964,176,079.49	829,765,169.24
证券保荐业务	70,664,338.74	112,925,125.00
财务顾问业务	532,403,969.10	694,779,887.62
资产管理业务	117,370,202.44	688,260,815.79
基金管理业务	46,050,528.83	4,455,021.02
投资咨询业务	14,037,489.23	11,666,704.49
其他	37,557,655.65	48,401,568.77
手续费及佣金支出	546,229,025.05	913,919,582.41
证券经纪业务	324,857,670.05	729,097,715.60
其中：代理买卖证券业务	324,857,670.05	726,915,461.25
交易单元席位租赁		2,182,254.35
期货经纪业务	8,226,905.71	8,524,152.74
投资银行业务	199,504,291.68	168,380,169.36
其中：证券承销业务	134,689,520.75	93,084,396.65
证券保荐业务	9,544,125.54	9,783,753.47
财务顾问业务	55,270,645.39	65,512,019.24
资产管理业务	4,334,746.64	5,741,209.08
基金管理业务		9,346.91
投资咨询业务	8,413,376.50	2,020,159.13
其他	892,034.47	146,829.59
手续费及佣金净收入	2,413,198,433.38	4,307,367,941.55
其中：财务顾问业务净收入	477,133,323.71	629,267,868.38
一并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	177,264,162.94	253,948,791.69
一并购重组财务顾问业务净收入—其他	202,575,018.53	143,107,249.74
一其他财务顾问业务净收入	97,294,142.24	232,211,826.95

### (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	4,251,477,546.90	18,178,867.99	35,424,621,936.98	42,963,891.77
银行理财产品	331,421,000.00	1,351,986.10	574,441,000.00	696,696.81
信托	72,300,000.00	294,937.84	244,190,000.00	296,159.91
其他	824,590,000.00	3,363,800.77	1,404,023,376.24	1,702,835.63
合计	5,479,788,546.90	23,189,592.70	37,647,276,313.22	45,659,584.12

### (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	59	120	5
期末客户数量	4,896	120	32
其中：个人客户	4,827	14	



机构客户	69	106	32
期初受托资金	6,325,874,470.64	82,323,679,173.47	222,759,346.60
其中：自有资金投入	1,413,824,014.61		
个人客户	1,843,623,404.85	58,120,000.00	
机构客户	3,068,427,051.18	82,265,559,173.47	222,759,346.60
期末受托资金	20,999,604,028.00	86,256,598,188.04	3,067,000,000.00
其中：自有资金投入	1,723,946,775.00		16,000,000.00
个人客户	4,359,579,433.83	726,361,200.00	
机构客户	14,916,077,819.17	85,530,236,988.04	3,051,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	19,222,432,125.21	85,356,116,102.03	3,067,000,000.00
其中：股票	1,318,762,757.65	2,808,764,382.22	
其他债券	14,642,754,242.08	6,913,194,976.90	
基金	2,534,289,948.28	7,641,632,100.12	
其他	726,625,177.20	67,992,524,642.79	3,067,000,000.00
当期资产管理业务净收入	33,899,155.28	77,088,982.10	2,047,318.42

手续费及佣金净收入的说明：

√适用 □不适用

受托客户资产管理业务明细情况：

单位：元 币种：人民币

资产项目	期末数	期初数	负债项目	期末数	期初数
受托管理资金存款	5,266,444,443.46	1,971,461,039.88	受托管理资金	111,647,175,898.88	90,164,688,377.68
客户结算备付金	338,002,678.72	42,019,713.06	应付款项	188,987,183.01	73,268,412.10
存出与托管客户资金	59,175,138.65	7,750,545.93	卖出回购	3,085,343,095.00	
应收款项	1,976,312,995.92	1,486,247,779.29			
受托投资	107,281,570,920.14	86,730,477,711.62			
其中：投资成本	107,645,548,227.24	85,829,522,489.47			
已实现未结算损益	-363,977,307.10	900,955,222.15			
合 计	114,921,506,176.89	90,237,956,789.78	合 计	114,921,506,176.89	90,237,956,789.78

## 61. 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	1,385,699,484.13	1,926,943,058.10
存放金融同业利息收入	519,860,265.07	655,168,398.62
其中：自有资金存款利息收入	201,854,510.94	189,760,835.06
客户资金存款利息收入	318,005,754.13	465,407,563.56
融资融券利息收入	642,002,983.69	1,065,974,178.08
买入返售金融资产利息收入	163,719,984.02	184,653,173.82
其中：约定购回利息收入	14,377,065.90	6,967,872.02
股权质押回购利息收入	87,039,387.33	141,156,811.73
其他	60,116,251.35	21,147,307.58
利息支出	1,351,329,292.61	1,713,101,829.01

客户资金存款利息支出	57,490,610.11	85,375,222.17
卖出回购金融资产利息支出	412,190,950.06	736,992,104.59
其中：报价回购利息支出	1,791,041.06	2,080,942.18
短期融资款利息支出	263,776,027.32	138,660,328.49
拆入资金利息支出	14,398,502.40	122,611,641.59
其中：转融通利息支出	3,361,750.00	114,155,094.42
应付债券利息支出	363,967,204.57	297,208,323.39
次级债券利息支出	215,656,061.73	231,213,698.67
其他	23,849,936.42	101,040,510.11
利息净收入	34,370,191.52	213,841,229.09

## 62. 投资收益

√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
权益法核算的长期股权投资收益	151,874,016.03	262,709,865.79
处置长期股权投资产生的投资收益		444,799.62
金融工具投资收益	1,218,712,671.20	3,672,593,360.01
其中：持有期间取得的收益	1,133,917,122.11	2,366,735,440.83
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	708,783,355.53	1,583,143,680.83
—持有至到期投资	39,197,989.56	16,037,411.12
—可供出售金融资产	279,690,599.95	755,045,086.81
—衍生金融工具	106,245,177.07	12,509,262.07
处置金融工具取得的收益	84,795,549.09	1,305,857,919.18
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	59,007,917.66	380,497,861.40
—可供出售金融资产	111,134,276.48	975,474,803.44
—衍生金融工具	-85,346,645.05	-50,114,745.66
其他		12,270,547.40
合计	1,370,586,687.23	3,948,018,572.82

投资收益的说明：

按权益法核算的长期股权投资收益

单位：元 币种：人民币

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的 原因
银华基金管理股份有限公司	151,874,016.03	262,709,865.79	行业波动，被投资单位 利润下滑
小 计	151,874,016.03	262,709,865.79	

## 63. 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	-219,084,860.65	77,735,269.53

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	-56,029,641.37	12,509,262.07
衍生金融工具	-10,107,684.37	-155,391,162.05
合计	-285,222,186.39	-65,146,630.45

#### 64. 其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数
租赁收入	5,382,629.37	1,578,122.60
代扣代缴个人所得税手续费	7,460,766.77	10,663,092.13
其他	2,571,121.25	1,565,187.64
合计	15,414,517.39	13,806,402.37

#### 65. 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	90,260,553.34	467,657,634.66
城市维护建设税	17,889,163.12	32,922,556.40
教育费附加	7,365,164.75	13,934,513.16
地方教育费附加	4,998,262.72	9,184,089.81
房产税	1,538,077.56	
其他	605,894.29	310,212.93
合计	122,657,115.78	524,009,006.96

税金及附加的说明：

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

#### 66. 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
职工薪酬	1,719,736,035.35	2,669,864,545.57
租赁费	99,368,419.57	90,788,245.56
咨询费	47,119,125.15	43,065,406.35
折旧费	61,139,278.12	44,986,898.52
业务招待费	52,681,831.94	54,865,116.81
电子设备运转费	41,537,418.71	31,618,875.75

差旅费	38,496,209.43	35,365,961.41
邮电费	40,390,328.45	37,786,534.61
公杂费	19,889,115.91	28,009,510.02
证券投资保护基金	27,837,188.67	42,957,419.30
其他	184,423,757.97	187,498,355.93
合计	2,332,618,709.27	3,266,806,869.83

### 67. 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	-57,803,716.34	136,616,329.99
二、可供出售金融资产减值损失	71,684,676.85	
三、长期股权投资减值损失		231,392,084.48
四、融资融券减值损失	-3,262,055.01	18,963,867.75
五、商誉减值损失		29,597,900.00
六、其他	2,753,841.95	16,759,009.37
合计	13,372,747.45	433,329,191.59

### 68. 其他业务成本

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数
投资性房地产摊销	3,487,348.42	3,472,071.32
代扣代缴个税手续费奖励支出	1,310,702.63	2,500,570.25
其他	617,587.85	584,537.55
合计	5,415,638.90	6,557,179.12

### 69. 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	261,546.68	104,408.36	261,546.68
其中：固定资产处置利得	261,546.68	104,408.36	261,546.68
非货币性资产交换利得		8,246,089.71	
政府补助	36,642,416.78	15,256,558.00	36,642,416.78
违约金及罚款收入		42,280.66	
其他	3,465,173.44	1,681,015.25	3,465,173.44
珠峰一号预计损失转回		62,427,316.71	
合计	40,369,136.90	87,757,668.69	40,369,136.90

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	与资产相关/与收益相关
专项人才奖励	12,530,300.00		与收益相关
财政奖励	5,630,120.78		与收益相关
产业扶持基金	18,481,996.00	15,256,558.00	与收益相关
合计	36,642,416.78	15,256,558.00	/

其他说明：

适用 不适用

## 70. 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	159,151.83	178,389.36	159,151.83
其中：固定资产处置损失	159,151.83	178,389.36	159,151.83
对外捐赠	4,567,288.07	10,669,441.00	4,567,288.07
非常损失	186.27	2,068.06	186.27
罚款支出	2,466,304.17	155,639.18	2,466,304.17
预计赔偿支出	64,180,032.69		64,180,032.69
其他	60,805.29	107,060.14	60,805.29
合计	71,433,768.32	11,112,597.74	71,433,768.32

## 71. 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	210,178,793.30	769,807,918.08
递延所得税费用	3,650,607.40	27,873,954.08
合计	213,829,400.70	797,681,872.16

### (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	1,126,530,778.08
按法定/适用税率计算的所得税费用	281,632,694.52
子公司适用不同税率的影响	-10,242,127.29
调整以前期间所得税的影响	1,172,809.21
非应税收入的影响	-109,598,694.96
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	8,827,610.98
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	42,037,108.24
所得税费用	213,829,400.70

其他说明：

适用 不适用

### 72. 其他综合收益

适用 不适用

其他综合收益详见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 55、其他综合收益”。

### 73. 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
收回存出保证金	373,158,718.94	
收回定期存款等	200,000,000.00	97,500,920.19
大额欠款收回	164,725,494.35	
衍生金融工具盈利	20,898,532.02	
收到政府补助	36,642,416.78	15,256,558.00
其他	18,879,690.83	3,311,794.38
合计	814,304,852.92	116,069,272.57

#### (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
存出交易所保证金		190,967,020.92
支付的清算款		215,667,721.13
衍生金融工具亏损		37,814,194.13
付现的费用	637,469,736.64	467,861,940.67
其他	60,205,783.14	144,015,759.93
合计	697,675,519.78	1,056,326,636.78

#### (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	3,040,896.12	597,389.13
合计	3,040,896.12	597,389.13

#### (4) 支付的其他与投资活动有关的现金

适用 不适用

#### (5) 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
收到结构化主体中第三方的现金	1,742,919,848.94	2,764,759,518.49
合计	1,742,919,848.94	2,764,759,518.49

**(6) 支付的其他与筹资活动有关的现金**
 适用  不适用

**74. 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	912,701,377.38	3,545,060,131.45
加：资产减值准备	13,372,747.45	433,329,191.59
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	64,626,626.54	44,986,898.52
无形资产摊销	26,610,253.25	21,236,057.73
长期待摊费用摊销	37,651,301.78	35,635,984.58
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）	-102,394.85	-73,981.00
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	285,222,186.39	65,146,630.45
利息支出（收益以“-”号填列）	843,399,293.62	569,560,216.78
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-83,311,977.77	-78,911,664.78
投资损失（收益以“-”号填列）	-581,896,882.01	-2,009,711,966.78
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	74,613,767.14	10,334,150.90
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	-70,964,860.22	17,539,803.18
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少（增加以“-”号填列）	-5,376,695,729.24	-1,434,274,409.25
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	1,804,669,526.19	4,179,411,201.46
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-8,565,590,778.20	-2,941,812,681.83
经营活动产生的现金流量净额	-10,615,695,542.55	2,457,455,563.00
<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	18,127,955,171.10	22,005,059,526.75
减：现金的期初余额	22,005,059,526.75	11,265,132,649.45
加：现金等价物的期末余额	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
减：现金等价物的期初余额	4,373,744,276.33	2,382,201,656.11
现金及现金等价物净增加额	-4,658,737,477.11	12,731,469,497.52

**(2) 本期支付的取得子公司的现金净额**
 适用  不适用

**(3) 本期收到的处置子公司的现金净额**
 适用  不适用

**(4) 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	18,127,955,171.10	22,005,059,526.75
其中：库存现金	187,825.51	177,139.83
可随时用于支付的银行存款	17,271,393,287.49	21,787,586,498.31
可随时用于支付的其他货币资金	856,374,058.10	217,295,888.61
二、现金等价物	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
其中：结算备付金	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
三、期末现金及现金等价物余额	21,720,066,325.97	26,378,803,803.08

其他说明：

 适用  不适用

**75. 所有者权益变动表项目注释**

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

 适用  不适用

**76. 所有权或使用权受到限制的资产**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6,777,416,976.00	用作卖出回购金融资产抵押物
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	87,691,624.13	停牌或暂停交易
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	201,079,152.76	限售股
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,836,229.21	融出证券
可供出售金融资产	71,058,370.00	用作卖出回购金融资产抵押物
可供出售金融资产	468,750.00	停牌或暂停交易
可供出售金融资产	830,154,504.21	限售股
融出资金	3,105,930,934.23	用作卖出回购金融资产抵押物
合计	11,075,636,540.54	/

**77. 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			18,127,955,171.10
其中：美元	17,318,793.00	6.9370	120,140,467.04
欧元	636.77	7.3068	4,652.75
港币	797,635,503.64	0.8945	713,484,958.01
澳元	6,085.34	5.0157	30,522.24
英镑	4,177.66	8.5094	35,549.38
加拿大元	237.33	5.1406	1,220.02
日元	679,848.00	0.0596	40,512.82
新加坡元	31,302.17	4.7995	150,234.77
台币	22,510.00	0.2157	4,855.40
人民币			17,294,062,198.67
其他应收款			327,840,956.19
其中：港元	98,669,055.36	0.8945	88,259,470.02
人民币			239,581,486.17
结算备付金			3,592,111,154.87
其中：美元	3,239,496.77	6.9370	22,472,389.09
港币	7,227,386.99	0.8945	6,464,897.67
人民币			3,563,173,868.11

(2) 境外经营实体说明，包括对于重要的境外经营实体，应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据，记账本位币发生变化的还应披露原因。

√适用 □不适用

西证国际投资有限公司为西南证券股份有限公司全资子公司，2013年11月成立于香港，资本金10亿港元。主要从事股权及项目投资，主要经营地为香港，记账本位币为港币。

#### 78. 套期

□适用 √不适用

#### 79. 其他

□适用 √不适用

### 八、母公司财务报表项目注释

#### 1. 应收款项

##### (1) 类别明细情况

单位：元 币种：人民币

种类	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
无收款风险组合	41,158,892.65	100.00		
合计	41,158,892.65	100.00		

(续上表)

种类	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
账龄组合计提坏账准备	7,723,189.40	100.00	75,334.18	0.98

合 计	7,723,189.40	100.00	75,334.18	0.98
-----	--------------	--------	-----------	------

**(2) 按款项性质**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
应收资产管理费	41,158,892.65	7,723,189.40
应收款项合计	41,158,892.65	7,723,189.40
减：应收款项减值准备		75,334.18
合 计	41,158,892.65	7,647,855.22

**2. 长期股权投资****(1) 明细情况**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	1,853,356,277.03	231,392,084.48	1,621,964,192.55
对子公司投资	4,030,764,254.80	29,597,900.00	4,001,166,354.80
合 计	5,884,120,531.83	260,989,984.48	5,623,130,547.35

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	1,857,209,928.48	231,392,084.48	1,625,817,844.00
对子公司投资	3,030,764,254.80	29,597,900.00	3,001,166,354.80
合 计	4,887,974,183.28	260,989,984.48	4,626,984,198.80

**(2) 对子公司投资**

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	本期计提减值准备	减值准备期末数
西证股权投资有限公司	600,000,000.00	200,000,000.00		800,000,000.00		
重庆股份转让中心有限责任公司	88,162,754.80			88,162,754.80		
西证创新投资有限公司	1,000,000,000.00	800,000,000.00		1,800,000,000.00		
西南期货有限公司	538,804,900.00			538,804,900.00		29,597,900.00
西证国际投资有限公司	803,796,600.00			803,796,600.00		
小 计	3,030,764,254.80	1,000,000,000.00		4,030,764,254.80		29,597,900.00

**(3) 对联营、合营企业投资**

同本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 17、长期股权投资”。

**3. 其他资产****(1) 明细情况**

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数	期初数
其他应收款	146,855,065.48	370,117,819.64

应收股利	713,431.27	214,563.50
长期待摊费用	85,071,120.16	57,207,034.49
预付款项	103,866,796.76	153,846,352.24
预缴税费	26,102,851.76	
小计	362,609,265.43	581,385,769.87

## (2) 其他应收款

### 1) 明细情况

#### ① 类别明细情况

单位：元 币种：人民币

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	127,822,500.00	77.99	12,782,250.00	10.00	115,040,250.00
按信用风险特征组合计提坏账准备					
其中：账龄组合	14,639,786.52	8.93	4,251,053.54	29.04	10,388,732.98
无收款风险组合	21,426,082.50	13.08			21,426,082.50
单项金额不重大并单项计提坏账准备					
合计	163,888,369.02	100.00	17,033,303.54	10.39	146,855,065.48

(续上表)

种类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	269,811,389.00	66.72	26,981,138.90	10	242,830,250.10
按信用风险特征组合计提坏账准备					
其中：账龄组合	76,181,497.26	18.84	7,302,273.85	9.59	68,879,223.41
无收款风险组合	58,408,346.13	14.44			58,408,346.13
单项金额不重大并单项计提坏账准备					
合计	404,401,232.39	100.00	34,283,412.75	8.48	370,117,819.64

#### ② 期末单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

其他应收款内容	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
质押回购款	127,822,500.00	12,782,250.00	10.00	预计回款期限较长
小计	127,822,500.00	12,782,250.00	10.00	

#### ③ 组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)

1 年以内	5,645,777.07	38.56	282,288.85	5.00
1-2 年	2,624,400.55	17.93	262,440.06	10.00
2-3 年	1,975,444.42	13.50	592,633.33	30.00
3-4 年	2,521,052.66	17.22	1,260,526.33	50.00
4-5 年	99,734.24	0.68	79,787.39	80.00
5 年以上	1,773,377.58	12.11	1,773,377.58	100.00
小 计	14,639,786.52	100.00	4,251,053.54	29.04

(续上表)

账 龄	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	65,673,865.05	86.20	3,283,693.25	5
1-2 年	3,077,260.33	4.04	307,726.03	10
2-3 年	4,393,269.06	5.77	1,317,980.72	30
3-4 年	1,213,725.24	1.59	606,862.62	50
4-5 年	186,831.76	0.25	149,465.41	80
5 年以上	1,636,545.82	2.15	1,636,545.82	100
小 计	76,181,497.26	100.00	7,302,273.85	9.59

## 2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

① 本期转回坏账准备 55,883,953.21 元,收回前期核销款增加坏账准备 38,633,844.00 元。

② 本期重要的坏账准备收回或转回情况

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	收回金额	计提坏账准备金额	收回方式
三佳电子(集团)有限责任公司	141,988,889.00	14,198,888.90	现金收回
上海中经投资管理有限公司	38,633,844.00	38,633,844.00	现金收回

## 3) 其他应收款项性质分类情况

单位: 元 币种: 人民币

款项性质	期末数	期初数
押金保证金	18,947,430.02	13,234,785.27
应收暂付款	15,167,575.13	78,635,058.12
股权认购款		42,720,000.00
股权质押回购款	127,822,500.00	269,811,389.00
其他	1,950,863.87	
其他应收款项合计	163,888,369.02	404,401,232.39
减: 其他应收款项减值准备	17,033,303.54	34,283,412.75
合 计	146,855,065.48	370,117,819.64

## 4) 其他应收款金额前 5 名情况

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例 (%)	坏账准备
蔡开坚	逾期股票质押回购款	127,822,500.00	1-2 年	77.99	12,782,250.00

重庆市劳动保障监察总队	押金	4,914,000.00	2-3年	3.00	
中保大厦有限公司	押金	2,332,242.13	2-3年	1.42	
信诚华远	押金	1,917,964.00	1年以内	1.17	
深圳耀华创建房地产发展有限公司	押金	1,050,588.00	2-3年	0.64	
小计		138,037,294.13		84.22	12,782,250.00

### (3) 应收股利

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数	未收回的原因	相关款项是否发生减值
账龄1年以内	713,431.27	214,563.50		
其中：				
基金、股票红利	713,431.27	214,563.50	宣告但尚未发放	否
合计	713,431.27	214,563.50		

### (4) 长期待摊费用

单位：元 币种：人民币

项目	期初数	本期增加	本期摊销	期末数
固定资产改良	29,174,774.93	34,310,061.80	14,133,271.04	49,351,565.69
网络工程	4,884,635.61	5,072,370.38	3,707,052.04	6,249,953.95
其他	23,147,623.95	22,377,317.79	16,055,341.22	29,469,600.52
合计	57,207,034.49	61,759,749.97	33,895,664.30	85,071,120.16

### (5) 预付款项

#### 1) 账龄分析

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	47,428,886.94	45.66		47,428,886.94
1-2年	41,153,220.09	39.62		41,153,220.09
2-3年	15,284,689.73	14.72		15,284,689.73
合计	103,866,796.76	100.00		103,866,796.76

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额	比例(%)	坏账准备	账面价值
1年以内	135,468,855.02	88.05		135,468,855.02
1-2年	18,377,497.22	11.95		18,377,497.22
合计	153,846,352.24	100		153,846,352.24

#### 2) 预付款项金额前5名情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	款项性质	账面余额	占预付款项余额的比例(%)
重庆泰正(集团)有限公司	购房款	24,777,940.00	23.86
重庆龙湖嘉凯地产开发有限公司	购房款	22,971,200.88	22.12

恒生电子股份有限公司	业务平台采购款	4,642,735.05	4.47
重庆云城两山投资开发有限公司	购房款	3,796,062.00	3.65
攀枝花金海实业有限公司	购房款	2,704,274.74	2.60
小计		58,892,212.67	56.70

#### 4. 手续费及佣金净收入

##### (1) 明细情况

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上年同期数
手续费及佣金收入	2,778,050,632.25	5,068,041,404.85
证券经纪业务	1,142,140,212.84	2,785,411,665.20
其中：代理买卖证券业务	995,815,884.74	2,607,412,958.09
交易单元席位租赁	124,200,773.14	132,339,122.99
代销金融产品业务	22,123,554.96	45,659,584.12
投资银行业务	1,462,275,045.26	1,572,147,940.07
其中：证券承销业务	885,251,613.28	815,713,052.12
证券保荐业务	58,081,132.07	107,229,750.00
财务顾问业务	518,942,299.91	649,205,137.95
资产管理业务	167,762,648.27	703,190,345.37
基金管理业务	2,097,268.35	
投资咨询业务	3,775,457.53	7,291,454.21
手续费及佣金支出	441,349,680.68	848,418,830.35
证券经纪业务	299,817,552.28	698,385,175.11
其中：代理买卖证券业务	299,817,552.28	696,202,920.76
交易单元席位租赁		2,182,254.35
投资银行业务	137,197,381.76	143,160,937.39
其中：证券承销业务	73,471,212.50	91,182,578.85
证券保荐业务	8,455,523.87	9,783,753.47
财务顾问业务	55,270,645.39	42,194,605.07
资产管理业务	4,334,746.64	6,823,054.51
投资咨询业务		49,663.34
手续费及佣金净收入	2,336,700,951.57	4,219,622,574.50
其中：财务顾问业务净收入	463,671,654.52	607,010,532.88
— 并购重组财务顾问业务—入—境内上市公司	177,264,162.94	253,948,791.69
— 并购重组财务顾问业务—入—其他	202,575,018.53	143,107,249.74
— 其他财务顾问业务净收入	83,832,473.05	209,954,491.45

##### (2) 代销金融产品业务收入

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数		上年同期数	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	4,194,977,546.90	17,112,830.25	35,424,621,936.98	42,963,891.77

银行理财产品	331,421,000.00	1,351,986.10	574,441,000.00	696,696.81
信托	72,300,000.00	294,937.84	244,190,000.00	296,159.91
其他	824,590,000.00	3,363,800.77	1,404,023,376.24	1,702,835.63
小计	5,423,288,546.90	22,123,554.96	37,647,276,313.22	45,659,584.12

## 5. 利息净收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数
利息收入	1,232,392,419.26	1,855,711,881.72
存放金融同业利息收入	483,460,352.27	619,824,210.73
其中：自有资金存款利息收入	170,747,222.37	163,514,804.17
客户资金存款利息收入	312,713,129.90	456,309,406.56
融资融券利息收入	597,618,313.52	1,052,368,185.88
买入返售金融资产利息收入	151,313,753.47	183,519,485.11
其中：约定购回利息收入	14,377,065.90	6,967,872.02
股权质押回购利息收入	87,029,027.19	141,156,811.73
利息支出	1,282,605,455.30	1,607,276,669.25
客户资金存款利息支出	57,490,610.12	85,207,789.46
卖出回购金融资产利息支出	399,990,953.03	736,992,104.59
其中：报价回购利息支出	1,791,041.06	2,080,942.18
短期借款利息支出	263,776,027.32	138,660,328.49
拆入资金利息支出	14,392,436.15	118,390,624.95
其中：转融通利息支出	3,361,750.00	114,155,094.42
应付债券利息支出	261,549,476.15	237,154,259.66
次级债券利息支出	215,656,061.73	231,213,698.67
其他	69,749,890.80	59,657,863.43
利息净收入	-50,213,036.04	248,435,212.47

## 6. 投资收益

### (1) 明细情况

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	151,874,016.03	262,709,865.79
成本法核算的长期股权投资收益	2,845,382.07	8,281,250.00
金融工具投资收益	1,140,993,877.22	2,841,608,339.92
其中：持有期间取得的收益	1,150,147,992.25	2,317,964,424.61
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	678,824,113.94	1,596,167,796.98
—可供出售金融资产	443,018,923.17	721,796,627.63
—衍生金融工具	28,304,955.14	
处置金融工具取得的收益	-9,154,115.03	523,643,915.31
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	22,158,831.58	328,209,518.41
—可供出售金融资产	19,210,699.40	229,371,639.53

一 衍生金融工具	-50,523,646.01	-33,937,242.63
合 计	1,295,713,275.32	3,112,599,455.71

**(2) 按权益法核算的长期股权投资收益**

单位：元 币种：人民币

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
银华基金管理股份有限公司	151,874,016.03	262,709,865.79	行业波动，被投资单位利润下滑
小计	151,874,016.03	262,709,865.79	

**7. 公允价值变动损益**

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上年同期数
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-216,482,338.97	119,043,809.20
衍生金融工具	67,184,434.08	-73,276,783.98
合 计	-149,297,904.89	45,767,025.22

**8. 收到其他与经营活动有关的现金**

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上期数
收回存出保证金	879,240,986.96	
政府补助	18,035,539.78	1,021,000.00
收到押金及保证金等		38,338,453.43
其他	15,240,223.60	13,066,114.80
合 计	912,516,750.34	52,425,568.23

**9. 支付其他与经营活动有关的现金**

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上期数
存出交易所保证金		526,726,889.66
衍生金融工具亏损	22,218,690.86	33,937,242.63
预付款项和支付保证金		125,062,577.48
业务及管理费用	238,350,471.87	374,852,286.32
投资者保护基金		34,759,322.52
其他		87,544,474.75
合 计	260,569,162.73	1,182,882,793.36

**10. 收到其他与投资活动有关的现金**

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上期数
处置固定资产收到的现金	4,031,379.82	289,079.48
合 计	4,031,379.82	289,079.48



**九、资产证券化业务的会计处理**
 适用  不适用

**十、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. 反向购买**
 适用  不适用

**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

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

 适用  不适用

**5. 其他原因的合并范围变动**

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：

 适用  不适用

新设子公司：

单位：元 币种：人民币

名 称	期末净资产	本期净利润
重庆榆钱儿电子商务有限责任公司	799,865.29	299,865.29
重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司	14,094,547.34	4,094,547.34
西证创新资本（深圳）有限公司	9,998,117.25	-1,882.75

**6. 其他**
 适用  不适用

**十一、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(%)		取得方式
				直接	间接	
西证股权投资有限公司	重庆	重庆	股权投资	100.00		设立
西证创新投资有限公司	重庆	重庆	资产管理、投资咨询等	100.00		设立
西证重庆股权投资基金管理有限公司	重庆	重庆	股权投资管理和咨询		100.00	设立
重庆西证小额贷款有限公司	重庆	重庆	小额贷款		100.00	设立
西证国际投资有限公司	香港	香港	股权投资	100.00		设立
西南期货有限公司	重庆	重庆	商品期货经纪、金融期货经纪	100.00		非同一控制下企业合并

重庆西证电子商务有限责任公司	重庆	重庆	商务信息和经济信息的咨询		100.00	设立
重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司	重庆	重庆	股权投资管理		51.00	非同一控制下企业合并
重庆股份转让中心有限责任公司	重庆	重庆	提供股权交易	53.00		非同一控制下企业合并
重庆榆钱儿电子商务有限责任公司	重庆	重庆	互联网商务信息咨询		100.00	设立
重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司	重庆	重庆	股权投资管理、股权投资咨询		98.00	设立
西证创新资本（深圳）有限公司	深圳	深圳	股权投资、投资管理、受托资产管理、投资咨询		100.00	设立
西证国际证券股份有限公司	香港	香港	经纪业务、自营业务等		74.22	非同一控制下企业合并

注：公司全资子公司西证国际投资有限公司非同一控制下合并西证国际证券股份有限公司后，继续通过公开市场增持西证国际证券股份有限公司 0.43% 的股份，截至期末合计持有 74.22% 股份。

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

对于本集团作为管理人或投资顾问的资产管理计划，作为普通合伙人或投资管理人的有限合伙企业，本集团在综合考虑对其拥有的投资决策权及可变回报的敞口等因素后，认定对部分资产管理计划及有限合伙企业拥有控制权，并将其纳入合并范围。

## (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	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
重庆股份转让中心有限责任公司	47.00%	34,114,559.19	2,523,263.35	119,482,151.90

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明：

适用  不适用

其他说明：

适用  不适用

**(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
重庆股份转让中心有限责任公司	123,494,725.17	528,593,869.21	652,088,594.38	397,048,134.21	1,140,992.76	398,189,126.97	137,524,237.29	561,793,744.25	699,317,981.54	511,142,002.44	1,682,522.67	512,824,525.11

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
重庆股份转让中心有限责任公司	126,693,860.23	72,491,823.38	70,570,056.42	4,479,289.72	55,872,020.07	14,306,337.03	14,934,486.53	42,520,510.37

**(4) 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制:**
 适用  不适用

**(5) 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

其他说明:

 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

**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	
银华基金管理股份有限公司	北京	深圳	基金管理	49.00		权益法核算

**(2) 重要合营企业的主要财务信息**
 适用  不适用

**(3) 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	
	银华基金管理股份有限公司	银华基金管理股份有限公司	银华基金管理股份有限公司	银华基金管理股份有限公司
资产合计	2,537,778,628.31		2,422,543,475.90	
负债合计	740,600,965.75		621,263,743.02	
少数股东权益	38,085,623.89		34,323,099.43	
归属于母公司股东权益	1,759,092,038.67		1,766,956,633.45	
按持股比例计算的净资产份额	861,955,098.94		865,808,750.39	
调整事项	760,009,093.61		760,009,093.61	
--商誉	991,401,178.09		991,401,178.09	
--内部交易未实现利润				
--减值准备	-231,392,084.48		-231,392,084.48	
对联营企业权益投资的账面价值	1,621,964,192.55		1,625,817,844.00	
营业收入		1,609,811,167.25		1,889,912,077.69

净利润		326,260,535.96		550,122,907.86
其他综合收益		1,194,831.63		1,330,621.54
综合收益总额		327,455,367.59		551,453,529.40
本年度收到的来自联营企业的股利		156,313,134.98		61,741,464.21

**(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

**(5) 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：**

适用  不适用

**(6) 合营企业或联营企业发生的超额亏损**

适用  不适用

**(7) 与合营企业投资相关的未确认承诺**

适用  不适用

**(8) 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债**

适用  不适用

**4. 重要的共同经营**

适用  不适用

**5. 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

**(1) 未纳入合并财务报表范围的结构化主体的基础信息**

2016年12月31日，与公司相关联、但未纳入公司合并财务报表范围的结构化主体，包括公司发起设立的资产管理计划、基金和有限合伙企业等，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，公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的收益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入；亦包括公司投资的其他机构设立的资产管理计划、有限合伙企业以及银行理财产品等，这些结构化主体的性质和目的主要是获取投资收益，公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的收益主要包括直接持有投资的投资收益。

2016年12月31日，由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要从事投资业务。这类结构化主体2016年12月31日的受托资产总额为109,943,545,329.54元。

**(2) 与权益相关资产负债的账面价值和最大损失敞口**

单位：元 币种：人民币

财务报表列报项目	账面价值		最大损失敞口	
	期末数	期初数	期末数	期初数
可供出售金融资产	3,016,411,978.56	1,830,867,636.58	3,016,411,978.56	1,830,867,636.58

## (3) 最大损失敞口的确定方法

不承担超额损失，以账面实际投资价值为限。

**6. 其他**

适用  不适用

**十二、与金融工具相关的风险**

适用  不适用

**十三、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	4,260,991,468.20	17,278,799,925.94		21,539,791,394.14
1. 交易性金融资产	4,260,991,468.20	17,278,799,925.94		21,539,791,394.14
(1) 债务工具投资	240,017,028.50	15,052,873,686.47		15,292,890,714.97
(2) 权益工具投资	4,020,974,439.70	2,220,474,598.00		6,241,449,037.70
(3) 衍生金融资产		5,451,641.47		5,451,641.47
(二) 可供出售金融资产	2,504,986,425.96	8,371,599,041.03		10,876,585,466.99
(1) 债务工具投资	208,845,367.30	2,581,489,486.02		2,790,334,853.32
(2) 权益工具投资	2,296,141,058.66	5,790,109,555.01		8,086,250,613.67
(三) 投资性房地产				
(四) 生物资产				
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	6,765,977,894.16	25,650,398,966.97		32,416,376,861.13
(五) 交易性金融负债	7,628,000.00			7,628,000.00
(六) 发行的交易性债券				
(七) 衍生金融负债		179,666,955.88		179,666,955.88
(八) 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		5,482,862,745.17		5,482,862,745.17
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	7,628,000.00	5,662,529,701.05		5,670,157,701.05
<b>二、非持续的公允价值计量</b>				
(一) 持有待售资产				
<b>非持续以公允价值计量的资产总额</b>				
<b>非持续以公允价值计量的负债总额</b>				

**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

公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

**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

项目	估值技术	输入值
债务工具	现金流量折现法	债券收益率
权益工具	投资标的市价组合法、折扣法	投资标的市价、缺乏市场流通性折扣
衍生金融负债	现金流量折现法	远期利率、折现率
指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	投资标的市价组合法	投资标的市价

**4. 持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息**
 适用  不适用

**5. 持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析**
 适用  不适用

**6. 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

**7. 本期内发生的估值技术变更及变更原因**
 适用  不适用

**8. 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

**9. 其他**
 适用  不适用

**十四、关联方及关联交易**
**1. 本企业的母公司情况**
 适用  不适用

单位：万元 币种：人民币

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例(%)	母公司对本企业的表决权比例(%)
重庆渝富资产经营管理集团有限公司	重庆	资产管理	1,000,000	26.99	26.99

本企业最终控制方是重庆市国有资产监督管理委员会。

## 2. 本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

适用  不适用

本公司的子公司情况详见“本年度报告第十一节、财务报告 十一、在其他主体中的权益”的说明。

## 3. 本企业合营和联营企业情况

适用  不适用

本企业重要的合营或联营企业详见“本年度报告第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 17、长期股权投资”。

本期与本公司发生关联方交易,或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

适用  不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
银华基金管理股份有限公司	联营企业

其他说明

适用  不适用

## 4. 其他关联方情况

适用  不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
重庆国际信托股份有限公司	公司前任董事担任首席执行官的公司
重庆三峡银行股份有限公司	公司前任董事担任其董事的公司
益民基金管理有限公司	公司前任董事担任其董事长的公司
重庆农村商业银行股份有限公司	公司控股股东的董、监事或高级管理人员担任其董事或高级管理人员的企业
重庆银行股份有限公司	公司控股股东的董、监事或高级管理人员担任其董事或高级管理人员的企业
安诚财产保险股份有限公司	公司控股股东的董、监事或高级管理人员担任其前任董事或高级管理人员的企业
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	持有公司 5%以上股份的股东
重庆高速公路集团有限公司	持有公司 5%以上股份的股东
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	持有公司 5%以上股份的股东

## 5. 关联交易情况

### (1) 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用  不适用

出售商品/提供劳务情况表

适用  不适用

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明

适用  不适用



**(2) 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况**

本公司受托管理/承包情况表:

 适用  不适用

关联托管/承包情况说明

 适用  不适用

本公司委托管理/出包情况表:

 适用  不适用

关联管理/出包情况说明

 适用  不适用**(3) 关联租赁情况**

公司出租交易席位给关联方并收取席位租赁费情况:

 适用  不适用

单位: 万元 币种: 人民币

承租方名称	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
银华基金管理股份有限公司	1,477.75	1,749.87
益民基金管理有限公司	88.94	61.76

本公司作为承租方:

 适用  不适用

关联租赁情况说明

 适用  不适用**(4) 关联担保情况**

本公司作为担保方

 适用  不适用

本公司作为被担保方

 适用  不适用

关联担保情况说明

 适用  不适用**(5) 关联方资金拆借** 适用  不适用**(6) 关联方资产转让、债务重组情况** 适用  不适用**(7) 关键管理人员报酬** 适用  不适用

公司董事、监事、高级管理人员共计 18 人 (包含离任人员), 本年度应付薪酬总额为 519.23 万元, 实际发放薪酬总额 515.73 万元。

**(8) 其他关联交易**

√适用 □不适用

## 1) 基金代销

公司与关联方开展基金代销业务，收取代销手续费情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
银华基金管理股份有限公司	124.75	39.03

## 2) 经纪业务

关联方在公司开立证券账户进行交易，本公司收取交易手续费情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆国际信托股份有限公司	520.69	1,729.15

## 3) 资产管理业务

公司向关联方提供资产管理业务服务，由此收取相应产品管理费收入情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆三峡银行股份有限公司	2,063.41	1,401.08
重庆银行股份有限公司	231.59	221.20
重庆市城市建设投资（集团）有限公司	21.91	
安诚财产保险股份有限公司		58,529.66

## 4) 回购交易

公司与重庆三峡银行股份有限公司进行回购交易情况：

单位：万元 币种：人民币

项目	本期数	上期数
回购金额		10,035.90
确认利息支出		1.09

## 5) 金融产品销售服务

公司向关联方提供金融产品承销服务，由此公司收取相关承销服务费情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆银行股份有限公司	300.00	

## 6) 购买金融产品

公司购买关联方公开发售的基金产品、受让关联方公开发行的集合资金信托计划项下信托受益权以及购买关联方公开发售的理财产品并了结获利情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
银华基金管理股份有限公司	43.37	
中建投信托有限责任公司	51.85	
重庆三峡银行股份有限公司	15.34	6.99
重庆银行股份有限公司		33.00

#### 7) 投资顾问服务

公司接受关联方委托，为其专项资产管理计划产品提供相关咨询服务，收取咨询服务费用情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
银华财富资本管理（北京）有限公司	14.26	

#### 8) 金融产品交易

公司因管理流动性需要，按净值申购关联方所管理的货币基金产品规模情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
银华基金管理股份有限公司	70,000.00	

#### 9) 银行间市场债券现券交易

公司固定收益业务日常开展过程中，通过银行间市场与关联方债券交易额情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆农村商业银行股份有限公司	50,000.00	
重庆银行股份有限公司		30,332.12

### 6. 关联方应收应付款项

#### (1) 应收项目

适用  不适用

#### (2) 应付项目

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	重庆渝富资产经营管理集团有限公司		220,156.97

#### (3) 代理买卖证券款

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
代理买卖证券款	重庆国际信托股份有限公司	41,316,451.15	127,708,721.91

**7. 关联方承诺** 适用  不适用**8. 其他** 适用  不适用**十五、股份支付****1. 股份支付总体情况** 适用  不适用**2. 以权益结算的股份支付情况** 适用  不适用**3. 以现金结算的股份支付情况** 适用  不适用**4. 股份支付的修改、终止情况** 适用  不适用**5. 其他** 适用  不适用**十六、承诺及或有事项****1. 重要承诺事项** 适用  不适用**2. 或有事项****(1) 资产负债表日存在的重要或有事项** 适用  不适用**1) 公司诉蔡开坚关于股票质押式回购交易纠纷一案**

公司于2014年11月3日向重庆仲裁委员会申请仲裁。重庆仲裁委员会于2015年1月20日作出(2014)渝仲字第1071号裁决书,裁决被申请人蔡开坚应向公司偿还本金人民币11,700万元以及相关利息、违约金等。现公司已向浙江台州市中级人民法院申请强制执行,以实现蔡开坚质押给公司的3,700万股“中捷股份(代码002021)”的优先受偿权。该案,因蔡开坚涉及其他诉讼案件,质押股票被浙江省高级人民法院冻结,现执行法院台州市中级人民法院正与浙江省高级人民法院积极沟通,推进该案执行。公司对蔡开坚的债权享有优先受偿权,通过必要的法律程序,能够保障公司的合法权益。

**2) 公司全资子公司西证小额贷款有限公司诉张抛贫、邓祖兰抵押借款合同纠纷案**

重庆西证小额贷款有限公司于2015年8月向江北区人民法院提起诉讼,请求法院判令被告张抛贫偿还欠款本金1,170万元并承担利息及实现债权的费用,判令被告邓祖兰承担连

带清偿责任。该案经法院审理后达成调解。因借款人未按时归还本息，该案已进入强制执行程序，现已收回本金 20 万元。

3) 公司全资子公司重庆西证小额贷款有限公司诉邓刚、邓丽娟等六保证人保证合同纠纷案

2016 年 7 月 1 日，重庆西证小额贷款有限公司向重庆市渝北区人民法院提起诉讼，请求法院判令邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆葢林科技发展有限公司六保证人连带支付重庆公信科技发展（集团）有限公司所欠西证小贷的借款本金 1,000 万元、利息、罚息及复利。2016 年 9 月 30 日，渝北区人民法院一审判决邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆葢林科技发展有限公司等六位保证人对本笔贷款的本金、利息、复利及罚息承担连带清偿责任。该案于 2016 年 12 月进入执行阶段。2017 年 1 月，重庆公信科技发展（集团）有限公司按重整方案对确认债权进行还款，现已收回本金 4.2453 万元。

2017 年 3 月，就邓钢、邓丽娟、邓苏轩所持四川广安建设集团有限公司等七公司债权，重庆西证小额贷款有限公司已通过重庆市渝北区人民法院向四川省广安市广安区人民法院申请参与分配；就吴开平、重庆葢林科技发展有限公司所持四川广安建设集团有限公司等七公司债权，重庆市渝北区人民法院已要求四川广安建设集团有限公司等七公司管理人将上述债权受偿额扣划至重庆西证小额贷款有限公司。

**(2) 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：**

√ 适用 □ 不适用

截至 2016 年 12 月 31 日止，公司无其他应披露未披露的或有事项。

### 3. 其他

□ 适用 √ 不适用

## 十七、资产负债表日后事项

### 1. 重要的非调整事项

□ 适用 √ 不适用

### 2. 利润分配情况

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

拟分配的利润或股利	564,510,912.40
经审议批准宣告发放的利润或股利	564,510,912.40

### 3. 销售退回

□ 适用 √ 不适用

### 4. 其他资产负债表日后事项说明

√ 适用 □ 不适用

### (1) 新华证券诉公司擅自处置委托股票案结案

2015 年 10 月，新华证券有限公司破产管理人向吉林省长春市中级人民法院提起诉讼，请求法院判令公司上海陆家嘴东路证券营业部（原公司上海定西路证券营业部）因 2003 年抛售原告股票向其赔偿损失及承担利息，并要求公司承担连带责任。2016 年 9 月 30 日，公司收到该案民事判决书，法院判令公司上海陆家嘴东路证券营业部给付新华证券有限公司抛售股票所得款及账户余额 19,137,895.20 元，支付原告抛售股票损失款 15,469,889.50 元，并给付原告利息损失，判决公司与公司上海陆家嘴东路证券营业部共同对上述债务承担给付责任。公司及公司上海陆家嘴东路证券营业部对该判决不服，已于 2016 年 10 月 14 日向吉林省高级人民法院提起上诉。公司根据上述情况，已按判决书计提截止 2016 年 12 月 31 日的本金及利息对应的预计负债 64,180,032.69 元。2017 年 3 月 1 日，吉林省高级人民法院作出了驳回上诉，维持原判的终审判决。2017 年 3 月 17 日，公司依据生效判决向新华证券支付款项 64,535,442.42 元。该案件已履行完毕。

### (2) 收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》事宜

2017 年 3 月 17 日，公司收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字 2017194 号），内容为：“因你公司在从事上市公司并购重组财务顾问业务活动中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，我会决定对你公司立案调查，请予以配合。”

根据《中华人民共和国证券法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》等相关规定，处于立案调查期间，中国证监会暂不受理公司作为保荐机构的推荐，暂不受理相关保荐代表人具体负责的推荐，暂不受理公司作为独立财务顾问出具的文件，预计公司投资银行业务在立案调查期间将受到影响，并可能对公司当期经营业绩造成一定的影响。

### (3) 利润分配事宜

2017 年 4 月 12 日，公司第八届董事会第二次会议审议通过公司 2016 年度利润分配预案：以公司截至 2016 年末总股本 5,645,109,124 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 1.00 元（含税）。上述议案尚需提交股东大会审议。

## 十八、风险管理

### 1. 风险管理政策及组织架构

#### (1) 风险管理政策

√适用□不适用

公司风险管理的目标是健全以净资本为核心的风控指标体系，建立覆盖各项业务和管理活动的风控系统，管好市场风险和信用风险、严控操作风险、防范流动性风险，确保公司整体风险可测可控可承受。基于该风险管理目标，公司建立健全与自身发展战略和业务规模相适应的全面风险管理体系，主要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。

公司按照《公司法》、《证券公司全面风险管理规范》、《证券公司内部控制指引》等相关要求，制订了《内部控制制度》、《风险管理制度》、《流动性风险管理办法》、《市场风险管理办法》、《操作风险管理办法》、《信用风险管理办法》、《压力测试管理办法》、《业务授权管理办法》、以及《净资本风险控制指标监控实施细则》、《融资融券业务风险监控作业指导书》、《约定式购回业务风险监控作业指导书》、《经纪业务风险监控作业指导书》、《资产管理业务风险监控作业指导书》、《证券投资业务风险监控作业指导书》等一系列规章制度，建立了全面、系统的风险控制政策与程序，严格遵循规范化、计量化、系统化的原则，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、及时应对及全程管理，以实现风险的可测、可控、可承受。

## (2) 风险治理组织架构

√适用□不适用

公司以分层架构、集中管理模式对整体风险进行管理，风险管理组织包括董事会及风险控制委员会，经理层、首席风险官及风险与合规管理委员会，风控、合规、审计等内控部门，各职能部门、业务单元风控岗共四个层级。

公司董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，设风险控制委员会，负责制订公司风险管理制度、目标和政策，审议风险控制策略、重大风险事件的评估报告和重大风险控制解决方案。

公司经理层负责经营管理中各项风险管理工作的落实，公司首席风险官负责统筹全面风险管理工作，首席风险官未兼任或者分管与其职责相冲突的职务或者部门，首席风险官有权参加或者列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。公司董事及股东不得违反规定的程序，直接向首席风险官下达指令或者干涉其工作。

公司设置独立的风险管理部门，在首席风险官领导下贯彻落实全面风险管理工作，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。公司流动性风险管理工作由风险管理部门和财务资金部门共同负责，声誉风险管理工作由公司品牌宣传部负责。公司各部门及分支机构、全体工作人员发现风险隐患时，积极主动、及时地向首席风险官或风险管理部门报告。

公司各部门及分支机构根据职责范围设置合规风控专兼职岗位，协助负责人履行风险管理职责。公司各分支机构负责人应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，并承担风险管理有效性的直接责任。

## 2. 信用风险

√适用□不适用

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约而带来损失的风险。

公司面临的信用风险主要来自两个方面：一是融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购等融资类业务的信用风险，即由于客户未能履行合同约定而给公司带来损失的风险；二是债券类投资的违约风险，即所投资债券的发行人或交易对手出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产损失或收益变化的风险。随着公司信用业务规模的迅猛发展，如发生违约风险事件，信用风险暴露，可能对公司造成一定损失。

公司融资类业务的信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物涉及法律纠纷等。公司主要通过通过对客户进行风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、建立业务禁入标准、加强项目尽职调查及后续管理 司法追索等手段，来对融资类业务的信用风险进行管理。截止报告期末，公司融资融券业务整体维持担保比例为 266.47%，最低为 128.75%；约定购回业务整体履约保障比例为 210.94%，最低为 175.91%；股票质押回购业务整体履约保障比为 281.19%，最低为 133.83%，担保物价值能够完全覆盖信用负债。

对债券投资的信用风险管理，主要借助风险限额、信用评级等手段，以信用风险限额和内部评级，从投资品种、发行主体和交易对手三个层面分类分级授权。其中，限额管理涵盖持仓限额和交易限额两大类。持仓限额包括组合信用风险值、交易对手信用风险敞口、信用债个券集中度、低评级信用债持仓占比等指标；交易限额包括低评级债券交易限额和交易对手结算风险限额，结算风险限额针对不同类别的交易对手，采用不同的交易结算方式，并设定不同的授权额度。所有超过交易额度授权的业务均需报上一级授权组织批准。交易对手内部信用评级管理体系包括交易对手内部信用评级、交易对手信用风险敞口计量、交易对手信用风险压力测试等。

在不考虑担保物或其他信用增级的情况下，公司最大信用风险敞口为金融资产的账面价值（即扣除已确认的减值准备后的余额）。

单位：人民币元

涉及信用风险科目	期末数	期初数
货币资金	18,127,955,171.10	22,205,059,526.75
结算备付金	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
存出保证金	625,158,757.97	998,317,476.91
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	21,534,339,752.67	16,376,728,884.07
融出资金	8,041,862,035.04	10,108,587,709.91
衍生金融资产	5,451,641.47	602,698.95
买入返售金融资产	2,945,409,505.66	1,323,333,999.84
应收款项	197,767,003.24	970,637,720.98
应收利息	538,898,651.77	414,863,179.56
可供出售金融资产	11,632,792,839.82	10,169,611,118.09
持有至到期投资	99,441,565.00	293,602,122.20
其他资产中的金融资产	463,192,621.52	1,330,088,628.91
合计	67,804,380,700.13	68,565,177,342.50



### 3. 流动风险

√适用□不适用

流动性是指资产在不遭受价值损失的情况下是否具有迅速变现的能力,资金的流动性影响到本公司偿还到期债务的能力。流动风险是指公司在履行与金融负债有关业务时遇到资金短缺的风险。

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

公司的流动性风险主要包括资产流动性风险和负债流动性风险。资产流动性风险是指公司所持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损失的可能;负债流动性风险是指由于公司缺乏现金,不能维持正常的业务支出或不能按时支付债务,以及流动资金不足以应对客户大规模赎回公司管理产品的风险。此外,投资银行业务大额包销、自营业务投资规模过大、期限错配、长期资产比例过高等因素,都会导致公司资金周转不畅,出现流动性困难的状况。

公司制定了《西南证券股份有限公司流动性风险管理办法》,明确公司流动性风险管理的目标、原则、组织体系和工作方法,从流动性限额、融资策略、现金流缺口、日间流动性管理、优质流动性资产配置、压力测试、应急计划等方面加强流动性管理,增强应对流动性冲击的能力。公司坚持资金营运安全性、流动性与效益性相统一的经营原则,强调资金的集中统一管理和运用,资金拆借、回购等业务由财务资金部集中管理,确保了资金流动性充足;通过合理控制各品种证券的投资规模,避免单一证券持仓过大和投资过于集中,同时建立投资组合量化指标分析,动态调整资产配置,确保投资组合的流动性适度充裕。

公司实时监控、定期计算流动性风险监管指标,截止 2016 年末公司风险覆盖率 268.11%、资本杠杆率 22.28%、流动性覆盖率 234.05%、净稳定资金率 148.96%、,均符合监管要求。

### 4. 市场风险

√适用□不适用

市场风险是指持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括外汇风险、利率风险、其他价格风险。

市场风险是指持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括外汇风险、利率风险、其他价格风险。

公司承担市场风险的业务部门主要有自营业务部门,及自有资金参与资管计划开展证券投资。当投资的股票、基金、股指期货、投资组合等权益类品种及权益类衍生品,在缺乏有效的对冲机制情景下,面对市场价格或波动率变化时,将可能产生价格风险。当投资债券等固定收益类证券面对利率、收益率曲线变化时,将可能产生利率风险。外汇汇率的变化,将

可能产生汇率风险。

公司建立起由董事会、投资决策委员会及自营业务部门组成投资业务三级决策与授权体系，对自有资金投资实行授权管理；同时，在业务部门之外，设立独立的风险管理部门对市场风险进行评估、监测和报告，保证公司整体市场风险水平在可控范围。公司采取风险限额措施对各业务单元所承担的市场风险进行控制，风险限额主要包括规模限额、止损限额、风险度限额等。董事会确定自营业务年度规模和最大可承受风险限额；投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；自营业务部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、止损线等进行前端控制；风险管理部门进行实时监控，及时进行风险提示，督促自营业务部门进行风险处置。此外，公司建立压力测试机制，对极端情景下公司可能面临的市场风险进行分析。极端情景主要包括：宏观经济衰退、证券市场价格及利率大幅不利变动、特殊风险事件等。通过压力测试评估公司自有资金投资在极端情况下的可能损失金额，判断公司整体的市场风险是否在可承受范围之内，并拟定应对措施。

目前权益类证券价格风险和固收产品利率风险是公司主要面对的市场风险。

权益类证券价格风险是指由于股票、基金及衍生品等权益类品种价格波动而导致的风险。公司通过头寸规模限额、量化风险限额、止损限额、集中度管理等风险限额指标管理市场风险，主要以风险价值（VaR）为衡量投资组合市场风险工具。风险价值（VaR）是指在一定时间段内投资组合因市场价格变动造成最大可能的损失。公司以 99%置信区间为计算标准，观察期为 1 个交易日，根据历史数据计算 VaR 值。

公司按风险类别分类的风险价值（VaR）如下：

项 目	期末数	本期最高	本期最低	本期平均
股价敏感型金融工具	3,957	22,598	3,957	9,696
利率敏感型金融工具	3,679	3,679	949	1,449
整体组合	5,664	22,521	4,741	9,694

利率风险是指市场利率变动的不确定性给固定收益投资组合造成影响的风险。公司固定收益投资主要是央票、国债、短期融资券、国债期货、利率互换等。公司每日计量监测固定收益投资组合久期、凸性、DV01 等指标来衡量固定收益投资组合的利率风险。截止 2016 年底，公司债券规模 115.23 亿元，其组合久期 2.11，基点价值 247.06 万。针对公司持有的固定收益类投资组合进行敏感性分析，假设利率增减 100 个基点对利润总额的影响如下：

利率变动	本期数	上期数
下降 100 个基点	247,063,645.00	320,865,189.31
上升 100 个基点	-247,063,645.00	-320,865,189.31

## 十九、其他重要事项

### 1. 前期会计差错更正

#### (1) 追溯重述法

适用  不适用

**(2) 未来适用法** 适用  不适用**2. 债务重组** 适用  不适用**3. 资产置换****(1) 非货币性资产交换** 适用  不适用**(2) 其他资产置换** 适用  不适用**4. 年金计划** 适用  不适用**5. 终止经营** 适用  不适用**6. 分部信息****(1) 报告分部的确定依据与会计政策:** 适用  不适用

公司以内部组织结构、管理要求等为依据确定经营分部，并以经营分部为基础确定报告分部。分别对证券经纪业务、自营投资业务、受托资产管理业务、投资银行业务、其他业务等的经营业绩进行考核。

**(2) 报告分部的财务信息**

2016 年度：

单位：元 币种：人民币

项 目	经纪业务	自营业务	投资银行业务	资产管理业务	其他业务	抵消	合 计
一、营业收入	1,003,103,700.71	865,079,628.39	1,219,814,961.81	187,007,474.01	356,653,855.98		3,631,659,620.90
其中：1. 手续费及佣金净收入	989,260,200.08	-76,625,878.21	1,235,394,447.78	186,842,366.09	78,327,297.64		2,413,198,433.38
2. 其他收入	13,843,500.63	941,705,506.60	-15,579,485.97	165,107.92	278,326,558.34		1,218,461,187.52
二、营业支出	848,111,034.88	168,450,427.82	261,290,623.50	44,766,988.61	1,151,445,136.59		2,474,064,211.40
三、营业利润	154,992,665.83	696,629,200.57	958,524,338.31	142,240,485.40	-794,791,280.61		1,157,595,409.50
四、资产总额	15,283,520,790.97	32,690,189,264.28	314,429,031.52	100,228,863.67	23,075,420,212.34	-464,096,117.65	70,999,692,045.13
五、负债总额	13,622,380,715.97	12,534,851,904.00	25,977,201.34	16,398,331.47	25,132,299,921.23		51,331,908,074.01
六、补充信息							
1. 折旧和摊销费用	43,836,256.51	230,968.48	4,861,685.70	405,929.65	79,553,341.23		128,888,181.57
2. 资本性支出	74,003,340.43	119,314.70	24,049,350.84	508,008.02	91,646,477.89		190,326,491.88

2015 年度：

单位：元 币种：人民币

项 目	经纪业务	自营业务	投资银行业务	资产管理业务	其他业务	抵消	合 计
一、营业收入	2,683,404,643.14	2,787,567,207.32	1,380,048,829.76	712,674,141.56	933,104,358.38		8,496,799,180.16
其中：1. 手续费及佣金净收入	2,252,948,525.07	-33,524,168.64	1,302,747,272.84	712,674,141.56	72,522,170.72		4,307,367,941.55
2. 其他收入	430,456,118.07	2,821,091,375.96	77,301,556.92		860,582,187.66		4,189,431,238.61
二、营业支出	928,629,693.38	211,747,304.74	231,125,046.91	70,636,459.14	2,788,563,743.33		4,230,702,247.50
三、营业利润	1,754,774,949.76	2,575,819,902.58	1,148,923,782.85	642,037,682.42	-1,855,459,384.95		4,266,096,932.66
四、资产总额	21,465,757,607.94	12,997,046,545.08	55,359,567.26	11,143,697.84	37,774,419,287.02	-554,288,472.05	71,749,438,233.09
五、负债总额	20,333,503,247.96	5,679,923,644.63	49,670,550.67	11,143,697.84	26,085,057,948.36		52,159,299,089.46
六、补充信息							
1. 折旧和摊销费用	23,460,466.32	400,039.93	2,535,350.79	691,991.06	74,771,092.73		101,858,940.83
2. 资本性支出	49,336,518.65	414,275.73	2,465,445.47	865,581.36	202,807,209.62		255,889,030.83

(3) 公司无报告分部的，或者不能披露各报告分部的资产总额和负债总额的，应说明原因

适用 不适用

(4) 其他说明：

适用 不适用

7. 租赁

适用 不适用

8. 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

9. 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
金融资产					
1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	16,376,728,884.07	-219,084,860.65			21,534,339,752.67
2、衍生金融工具	-164,107,630.04	-10,107,684.37			-174,215,314.41
3、可供出售金融资产	9,507,042,013.45		-9,429,085.65	71,684,676.85	10,876,585,466.99
金融资产小计	25,719,663,267.48	-229,192,545.02	-9,429,085.65	71,684,676.85	32,236,709,905.25
上述合计	25,719,663,267.48	-229,192,545.02	-9,429,085.65	71,684,676.85	32,236,709,905.25
金融负债	3,772,653,089.25	-56,029,641.37			5,490,490,745.17

10. 外币金融资产和金融负债

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
金融资产					
1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	377,696,242.31	-17,578,727.53			354,864,169.98
2、衍生金融资产	503,058.95	4,730,903.85			5,233,962.80
3、贷款和应收款	58,298.61				36,765.33
4、可供出售金融资产	59,020,542.70		1,637,359.95	739,605.28	284,461,446.60
5、持有至到期投资	293,602,122.00				
金融资产小计	730,880,264.57	-12,847,823.68	1,637,359.95	739,605.28	644,596,344.71
金融负债	118,263,836.43	-137,953,023.68			167,477,025.71

11. 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

适用 不适用

**12. 其他**
 适用  不适用

**二十、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	102,394.85	
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）	36,642,416.78	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-67,809,443.05	主要系计提预计负债64,180,032.69元
所得税影响额	8,096,745.23	
少数股东权益影响额	-842,639.82	
合计	-23,810,526.01	

**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	4.84	0.16	0.16
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	4.97	0.17	0.17

**(1) 加权平均净资产收益率计算过程**

项目	序号	本期数	
归属于公司普通股股东的净利润	A	917,572,729.00	
非经常性损益	B	-23,810,526.01	
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	941,383,255.01	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	19,017,736,045.79	
发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产	E		
新增净资产次月起至报告期期末的累计月数	F		
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产 1	G	733,864,186.12	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数 1	H	7	
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 2			
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数 2			
其他	其他综合收益影响	I1	-200,172,445.96
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数	J1	6
报告期月份数	K	12	
加权平均净资产	$L = \frac{D+A}{2} + \frac{E \times F}{K} - \frac{G}{K} \times \frac{H}{K} \pm \frac{I}{K} \times \frac{J}{K}$	18,948,348,745.41	
加权平均净资产收益率	$M = A/L$	4.84%	
扣除非经常损益加权平均净资产收益率	$N = C/L$	4.97%	

**(2) 基本每股收益和稀释每股收益计算过程**

## 1) 基本每股收益的计算过程

项 目	序号	本期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	917,572,729.00
非经常性损益	B	-23,810,526.01
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	941,383,255.01
期初股份总数	D	5,645,109,124.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E	
发行新股或债转股等增加股份数	F	
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G	
因回购等减少股份数	H	
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I	
报告期缩股数	J	
报告期月份数	K	12
发行在外的普通股加权平均数	$L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$	5,645,109,124.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.16
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.17

## 2) 稀释每股收益计算过程

稀释每股收益的计算过程和基本每股收益的计算过程相同。

**3. 境内外会计准则下会计数据差异**

适用  不适用

**4. 其他**

适用  不适用

## 第十二节 备查文件目录

备查文件目录	载有公司法定代表人签字和公司盖章的公司2016年年度报告全文文本
备查文件目录	载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的公司2016年年度财务报表
备查文件目录	载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件
备查文件目录	报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿
备查文件目录	其他有关资料

董事长：廖庆轩

总裁、法定代表人：吴坚

董事会批准报送日期：2017年4月12日

### 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

序号	类型	时间	内容
1	人员任职资格	2016 年 7 月	中国证监会重庆监管局向公司下发了《关于核准廖庆轩证券公司董事长类人员任职资格的批复》（渝证监许可[2016]1 号），核准廖庆轩证券公司董事长任职资格。
2	取得业务资格	2016 年 4 月	深圳证券交易所向公司下发了《关于同意西南证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函》（深证函[2016]279 号），同意公司开展上市公司股权激励行权融资业务试点。
3	公司债券相关	2016 年 1 月	上海证券交易所向公司下发了《关于对西南证券股份有限公司 2016 年非公开发行证券公司短期公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函[2016]50 号），同意公司本次证券公司短期公司债券拟发行金额为 150 亿元，自来函出具之日起 12 个月内组织发行。

### 二、监管部门对公司的分类结果

√适用□不适用

年度	分类结果
2016	A 类 A 级
2015	A 类 AA 级
2014	A 类 AA 级