

西南证券股份有限公司

2017 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、公司全体董事出席董事会会议。

三、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。

四、公司负责人吴坚、主管会计工作负责人吴坚及会计机构负责人（会计主管人员）叶平声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司2017年度利润分配预案为：以公司截至2017年末总股本5,645,109,124.00股为基数，向全体股东每10股派发现金红利0.50元（含税），实际分配现金利润为282,255,456.20元，占本年度归属于母公司股东净利润的比重为42.20%，本次分配后剩余未分配利润结转至下一年度。2017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十一次会议审议通过，尚需提交股东大会审议。

六、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。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、重大风险提示

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、其他

适用 不适用

目录

第一节	释义.....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	公司业务概要.....	17
第四节	经营情况讨论与分析.....	19
第五节	重要事项.....	38
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	48
第七节	优先股相关情况.....	53
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	54
第九节	公司治理.....	64
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.....	179
第十三节	证券公司信息披露.....	180

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(http://www.sse.com.cn)

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	14,351,126,505.94	14,791,810,687.33

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

	董事、总裁、董事会秘书	证券事务代表
姓名	吴坚	刘瑞
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	wujian@swsc.com.cn	liurui@swsc.com.cn

注：2017年7月26日，公司收到副总裁兼董事会秘书徐鸣镝先生的书面辞职申请，因个人原因，徐鸣镝先生申请辞去在公司所担任的上述职务。公司将按照相关规定尽快聘任新的董事会秘书，在此期间，由公司法定代表人、董事、总裁吴坚先生代行董事会秘书职责。

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）。

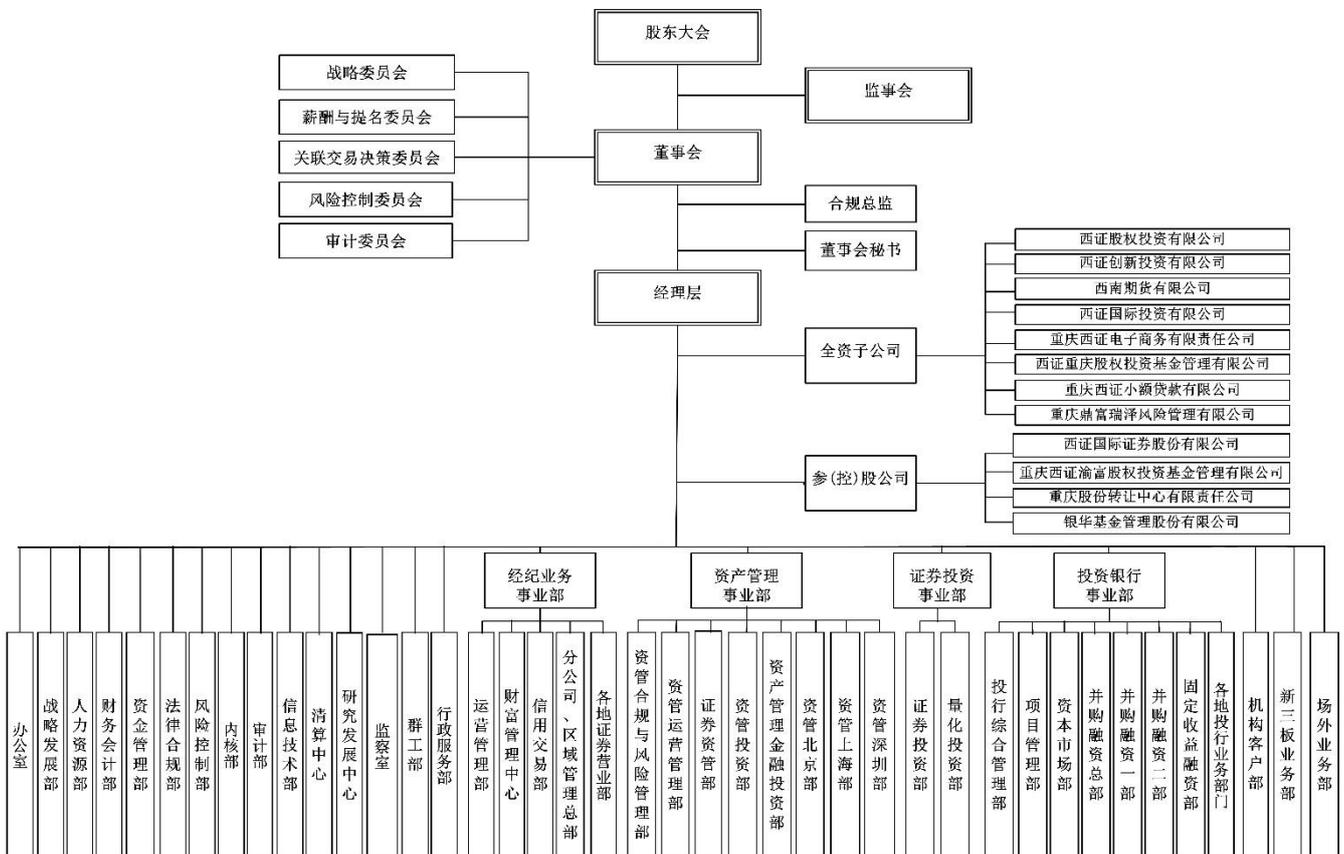
2015年9月，根据公司2015年第四次临时股东大会通过的《关于公司2015年半年度利润分配及资本公积金转增股本预案的议案》，公司以资本公积金向全体股东每10股转增10股，总股本相应增至5,645,109,124股，并于2015年9月30日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成转增股份的登记托管手续，公司注册资本相应变更为5,645,109,124元。

（二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

公司遵循《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》、中国证监会有关规章制度及《公司章程》的规定，规范运作，构建了科学有效的法人治理结构，建立了符合公司发展需要的组织架构和运行机制。

截至2017年12月31日，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 2017 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 94 家，分公司 34 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	证券分支机构名称	运营状态
1	重庆	重庆第一分公司	运营中
2		重庆第二分公司	运营中
3		重庆第三分公司	运营中
4		重庆第四分公司	运营中
5		重庆嘉陵桥西村证券营业部	运营中
6		重庆大石坝七村证券营业部	运营中
7		重庆渝碚路证券营业部	运营中
8		重庆惠工路证券营业部	运营中
9		重庆杨家坪正街证券营业部	运营中
10		重庆春晖路证券营业部	运营中
11		重庆北碚证券营业部	运营中
12		重庆金渝大道证券营业部	运营中
13		重庆南川证券营业部	运营中
14		重庆万州高笋塘证券营业部	运营中
15		重庆涪陵滨江路证券营业部	运营中
16		重庆长寿证券营业部	运营中
17		重庆潼南证券营业部	运营中
18		重庆荣昌证券营业部	运营中
19		重庆垫江证券营业部	运营中
20		重庆合川希尔安大道证券营业部	运营中
21		重庆黄山大道证券营业部	运营中
22		重庆秀山证券营业部	运营中
23		重庆万盛大道证券营业部	运营中
24		重庆开州证券营业部	运营中
25		重庆永川红河大道证券营业部	运营中
26		重庆江津江州大道证券营业部	运营中
27		重庆巴南证券营业部	运营中
28		重庆大足证券营业部	运营中
29		重庆璧山名豪街证券营业部	运营中
30		重庆武隆建设东路证券营业部	运营中
31		重庆铜梁证券营业部	运营中
32		重庆忠县证券营业部	运营中
33		重庆丰都证券营业部	运营中
34		重庆黔江证券营业部	运营中
35		重庆酉阳证券营业部	运营中
36		重庆綦江证券营业部	运营中
37		重庆奉节永安路证券营业部	运营中

38		重庆梁平证券营业部	运营中
39		重庆云阳云江大道证券营业部	运营中
40		重庆石柱证券营业部	运营中
41		重庆彭水证券营业部	运营中
42		重庆巫山证券营业部	运营中
43		重庆巫溪证券营业部	运营中
44		重庆城口证券营业部	运营中
45	北京	北京分公司	运营中
46		北京北三环中路证券营业部	运营中
47		北京西城证券营业部	运营中
48		北京海淀证券营业部	运营中
49		北京昌平证券营业部	运营中
50		北京东城证券营业部	运营中
51		北京房山证券营业部	运营中
52		北京平谷证券营业部	运营中
53	天津	天津分公司	运营中
54	上海	上海分公司	运营中
55		上海普陀区平利路证券营业部	运营中
56		上海田林东路证券营业部	运营中
57		上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部	运营中
58	广东	深圳分公司	运营中
59		广州分公司	运营中
60		深圳滨河大道证券营业部	运营中
61		深圳深南大道证券营业部	运营中
62		中山中山四路证券营业部	运营中
63	广西	广西分公司	运营中
64		柳州晨华路证券营业部	运营中
65	浙江	浙江分公司	运营中
66		杭州庆春东路证券营业部	运营中
67		温州汤家桥路证券营业部	运营中
68		金华丹溪路证券营业部	运营中
69		绍兴延安东路证券营业部	运营中
70		义乌城中中路证券营业部	运营中
71		宁波江东北路证券营业部	运营中
72		台州市府大道证券营业部	运营中
73		萧山市心北路证券营业部	运营中
74	江西	江西分公司	运营中
75	江苏	江苏分公司	运营中
76		徐州二环西路证券营业部	运营中
77		苏州仲英大道证券营业部	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	福州分公司	运营中
82		龙岩西陂路证券营业部	运营中
83	山东	济南分公司	运营中
84		淄博柳泉路证券营业部	运营中
85	河北	河北分公司	运营中
86		唐山新华西道证券营业部	运营中

87	河南	河南分公司	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	湖北分公司	运营中
93		荆州北京路证券营业部	运营中
94	湖南	湖南分公司	运营中
95		湘潭传奇西路证券营业部	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	山西分公司	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	四川分公司	运营中
103		成都天府大道证券营业部	运营中
104		攀枝花机场路证券营业部	运营中
105		德阳岷江西路证券营业部	运营中
106		绵阳安昌路证券营业部	运营中
107		乐山人民北路证券营业部	运营中
108	云南	云南分公司	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	贵州分公司	运营中
113	陕西	西北分公司	运营中
114		西安高新路证券营业部	运营中
115	甘肃	甘肃分公司	运营中
116	安徽	安徽分公司	运营中
117		淮南龙湖中路证券营业部	运营中
118		马鞍山花雨路证券营业部	运营中
119	青海	青海分公司	运营中
120	辽宁	大连分公司	运营中
121		沈阳分公司	运营中
122	吉林	吉林分公司	运营中
123	黑龙江	黑龙江分公司	运营中
124	宁夏	宁夏分公司	运营中
125		吴忠迎宾大街证券营业部	运营中
126	内蒙古	内蒙古分公司	运营中
127		包头金融广场证券营业部	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、何施岑

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	2017年	2016年	本期比上年同期 增减(%)	2015年
营业收入	3,060,764,762.10	3,631,762,015.75	-15.72	8,496,725,199.16
归属于母公司股东的净利润	668,800,161.74	917,572,729.00	-27.11	3,554,650,541.89
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	697,915,991.19	941,383,255.01	-25.86	3,497,377,497.12
经营活动产生的现金流量净额	-4,161,237,066.03	-10,615,695,542.55		2,457,455,563.00
其他综合收益	367,121,614.43	-179,319,796.13		-438,017,070.48
	2017年末	2016年末	本期末比上年同 期末增减(%)	2015年末
资产总额	63,694,293,593.54	70,999,692,045.13	-10.29	71,749,438,233.09
负债总额	43,645,632,040.02	51,331,908,074.01	-14.97	52,159,299,089.46
归属于母公司股东的权益	19,383,827,898.83	19,001,272,142.71	2.01	19,017,736,045.79
所有者权益总额	20,048,661,553.52	19,667,783,971.12	1.94	19,590,139,143.63

(二) 主要财务指标

主要财务指标	2017年	2016年	本期比上年同期增减(%)	2015年
基本每股收益(元/股)	0.12	0.16	-25.00	0.63
稀释每股收益(元/股)	0.12	0.16	-25.00	0.63
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.12	0.17	-29.41	0.62
加权平均净资产收益率(%)	3.49	4.84	减少1.35个百分点	19.83
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	3.65	4.97	减少1.32个百分点	19.51

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	14,351,126,505.94	14,791,810,687.33
净资产	19,120,317,637.97	18,542,782,937.36
风险覆盖率(%)	211.53	268.11
资本杠杆率(%)	25.30	22.28
流动性覆盖率(%)	469.04	234.05
净稳定资金率(%)	145.38	148.96
净资本/净资产(%)	75.06	79.77
净资本/负债(%)	52.24	49.40
净资产/负债(%)	69.60	61.92
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	50.84	50.16
自营固定收益类证券/净资本(%)	130.78	109.47

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、2017 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	507,100,953.09	858,723,323.02	861,016,930.56	833,923,555.43
归属于上市公司股东的净利润	23,885,995.69	342,823,875.44	223,819,313.27	78,270,977.34
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	23,638,185.00	378,525,942.52	228,176,542.68	67,575,320.99
经营活动产生的现金流量净额	-383,069,948.49	-527,612,693.04	-655,154,704.09	-2,595,399,720.41

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

季度数据与已披露定期报告的差异,系根据财政部 2017 年 12 月发布的《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》(财会[2017]30 号)进行的调整。

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	2017 年金额	2016 年金额	2015 年金额
非流动资产处置损益	-102,751.22	102,394.85	370,818.62
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	17,702,396.26	36,642,416.78	15,256,558.00
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	-43,570,042.57	-67,809,443.05	53,216,404.24
少数股东权益影响额	-872,481.98	-842,639.82	-762,378.74
所得税影响额	-2,272,949.94	8,096,745.23	-19,054,447.06
合计	-29,115,829.45	-23,810,526.01	57,273,044.77

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	21,534,339,752.67	22,356,579,297.77	822,239,545.10	758,365,240.53
可供出售金融资产	10,876,585,466.99	8,229,022,945.84	-2,647,562,521.15	849,156,127.21
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	4,492,139,574.10	-998,351,171.07	2,434,299.46
衍生金融工具	-174,215,314.41	-68,737,082.55	105,478,231.86	37,550,535.07
合计	37,727,200,650.42	35,009,004,735.16	-2,718,195,915.26	1,647,506,202.27

十三、其他

√适用 □不适用

(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	2017年12月31日	2016年12月31日	增减率(%)
货币资金	13,408,192,597.14	18,127,955,171.10	-26.04
结算备付金	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87	-29.43
融出资金	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04	8.98
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	22,356,579,297.77	21,534,339,752.67	3.82
买入返售金融资产	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66	4.07
应收利息	512,922,375.64	538,898,651.77	-4.82
存出保证金	307,274,690.77	625,158,757.97	-50.85
可供出售金融资产	8,859,087,222.71	11,632,792,839.82	-23.84
长期股权投资	1,648,571,467.49	1,621,964,192.55	1.64
固定资产	353,408,660.67	335,328,716.71	5.39
在建工程	340,110,741.83	285,779,102.36	19.01
其他资产	740,750,566.12	733,221,648.33	1.03
应付短期融资款	401,300,000.00	7,368,400,000.00	-94.55
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	4,492,139,574.10	5,490,490,745.17	-18.18
卖出回购金融资产款	9,818,365,760.00	9,680,845,721.37	1.42
代理买卖证券款	9,887,672,483.98	13,292,127,523.64	-25.61
应付职工薪酬	889,464,403.44	1,000,181,468.37	-11.07
应付利息	285,683,496.85	341,155,812.48	-16.26
预计负债		64,180,032.69	-100.00
应付债券	16,953,849,842.62	13,447,553,351.21	26.07
其他负债	553,940,916.13	155,743,389.49	255.68
实收资本(或股本)	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00	
资本公积	7,767,343,370.78	7,852,067,958.06	-1.08
其他综合收益	405,525,788.48	42,534,694.42	853.40
盈余公积	1,009,845,259.83	926,129,306.65	9.04
一般风险准备	1,942,710,531.26	1,775,278,624.90	9.43
未分配利润	2,613,293,824.48	2,760,152,434.68	-5.32
利润表项目	2017年度	2016年度	增减率(%)
营业收入	3,060,764,762.10	3,631,762,015.75	-15.72

手续费及佣金净收入	1,424,824,482.04	2,413,198,433.38	-40.96
利息净收入	-217,510,672.53	34,370,191.52	-732.85
投资收益	1,999,857,981.16	1,370,586,687.23	45.91
公允价值变动收益	-77,136,428.06	-285,222,186.39	
其他业务收入	24,177,293.12	15,414,517.39	56.85
营业支出	2,174,557,473.09	2,474,064,211.40	-12.11
税金及附加	26,689,045.90	122,657,115.78	-78.24
业务及管理费	2,082,126,668.51	2,332,618,709.27	-10.74
资产减值损失	54,142,649.58	13,372,747.45	304.87
营业外支出	44,562,877.78	71,274,616.49	-37.48
所得税费用	151,755,184.61	213,829,400.70	-29.03
净利润	690,882,061.83	912,701,377.38	-24.30
其他综合收益的税后净额	367,121,614.43	-179,319,796.13	

(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	2017年12月31日	2016年12月31日	增减率(%)
货币资金	11,564,205,529.93	15,805,966,481.75	-26.84
结算备付金	1,756,167,097.71	2,838,128,517.04	-38.12
融出资金	8,373,243,608.04	7,825,820,017.29	7.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	16,357,142,726.96	14,441,228,108.27	13.27
买入返售金融资产	2,131,464,220.86	2,533,907,230.66	-15.88
应收利息	368,053,966.18	365,204,205.21	0.78
可供出售金融资产	7,578,727,993.00	9,569,315,916.50	-20.80
长期股权投资	5,649,737,822.29	5,623,130,547.35	0.47
固定资产	342,651,847.91	319,545,862.08	7.23
在建工程	340,110,741.83	285,779,102.36	19.01
其他资产	314,442,476.10	362,609,265.43	-13.28
应付短期融资款	401,300,000.00	7,368,400,000.00	-94.55
卖出回购金融资产款	9,818,365,760.00	8,939,845,721.37	9.83
代理买卖证券款	8,827,342,461.46	12,298,424,590.05	-28.22
应付职工薪酬	747,733,009.70	920,304,584.29	-18.75
应付利息	276,492,511.86	331,051,642.36	-16.48
应付债券	15,451,276,266.10	11,963,437,167.47	29.15
其他负债	514,907,202.43	106,970,597.32	381.35
实收资本(或股本)	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00	
资本公积	7,767,998,295.28	7,852,722,882.56	-1.08
其他综合收益	361,431,737.92	-28,178,930.61	
盈余公积	1,009,845,259.83	926,129,306.65	9.04
一般风险准备	1,942,710,531.26	1,775,278,624.90	9.43
未分配利润	2,393,222,689.68	2,371,721,929.86	0.91
利润表项目	2017年度	2016年度	增减率(%)
营业收入	2,841,959,621.56	3,447,450,040.70	-17.56

手续费及佣金净收入	1,343,816,378.25	2,336,700,951.57	-42.49
利息净收入	-10,737,198.36	-50,213,036.04	
投资收益	1,683,572,084.54	1,295,713,275.32	29.93
公允价值变动收益	-197,048,321.94	-149,297,904.89	
其他业务收入	21,875,079.57	12,422,522.04	76.09
营业支出	1,816,591,875.57	2,204,407,712.16	-17.59
税金及附加	24,257,408.11	94,632,122.02	-74.37
业务及管理费	1,712,722,610.40	2,040,891,852.82	-16.08
资产减值损失	68,855,707.01	64,562,170.96	6.65
营业外支出	44,156,590.04	78,215,974.27	-43.55
所得税费用	144,495,856.88	196,674,960.12	-26.53
净利润	837,159,531.76	989,004,635.49	-15.35
其他综合收益的税后净额	389,610,668.53	-240,231,953.90	

(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	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	增减率 (%)	变动原因说明
应收款项	50,247,697.25	197,767,003.24	-74.59	收回清算款
存出保证金	307,274,690.77	625,158,757.97	-50.85	主要系期货保证金、履约保证金减少
持有至到期投资		99,441,565.00	-100.00	持有的海航债券到期
递延所得税资产	260,551,227.47	162,122,654.79	60.71	主要系应付职工薪酬暂时性差异部分产生的递延所得税资产增加
应付短期融资款	401,300,000.00	7,368,400,000.00	-94.55	偿还到期短期公司债
应付款项	55,351,795.02	139,615,260.36	-60.35	支付清算款
预计负债		64,180,032.69	-100.00	诉讼赔偿履行完毕
递延所得税负债	118,844,992.53	8,239,428.84	1,342.39	可供出售金融资产浮盈所致
其他负债	553,940,916.13	155,743,389.49	255.68	其他应付款增加
其他综合收益	405,525,788.48	42,534,694.42	853.40	可供出售金融资产浮盈所致
利润表项目	2017 年度	2016 年度	增减率 (%)	变动原因说明
手续费及佣金净收入	1,424,824,482.04	2,413,198,433.38	-40.96	投行业务实现的收入减少
利息净收入	-217,510,672.53	34,370,191.52	-732.85	支付结构化主体的外部投资者利息增加
投资收益	1,999,857,981.16	1,370,586,687.23	45.91	可供出售金融资产实现的投资收益增加
公允价值变动收益	-77,136,428.06	-285,222,186.39		衍生金融工具实现的公允价值变动收益增加
其他收益	17,702,396.26			因政府补助准则的修订而进行科目调整
其他业务收入	24,177,293.12	15,414,517.39	56.85	租赁收入及代扣代缴个人所得税手续费收入增加
税金及附加	26,689,045.90	122,657,115.78	-78.24	应税收入减少以及营改增的影响
资产减值损失	54,142,649.58	13,372,747.45	304.87	主要为可供出售金融资产计提的减值损失
其他业务成本	11,599,109.10	5,415,638.90	114.18	主要系代扣代缴个税手续费奖励支出增加
营业外收入	992,835.21	40,107,590.22	-97.52	因政府补助准则的修订而进行科目调整
营业外支出	44,562,877.78	71,274,616.49	-37.48	主要为罚没支出
其他综合收益的税后净额	367,121,614.43	-179,319,796.13		可供出售金融资产浮盈所致

第三节 公司业务概要

一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

(一) 主要业务及经营模式

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。

公司经纪业务主要为接受客户委托,按其要求代理买卖证券并收取佣金。此外还包括金融产品销售、融资融券、股票质押与约定购回、股票期权、投资顾问等业务。公司经纪业务以合规风控为前提,积极推进财富管理、信用交易等各项业务的多元化发展,在系统建设、综合业务平台搭建、产品货架、渠道建设、高净值客户服务、智能投顾、互联网金融、网点优化、服务地方实体经济等方面均取得了长足进步。

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。公司投行业务延续精品投行发展模式,整体实力较强,业务较为均衡。

公司自营业务主要以自有资金及合法筹措的资金在资本市场进行主动性投资和量化投资等,业务品种主要包括权益类、固定收益类产品、另类投资产品以及衍生品等。公司自营业务综合平衡回报率与风险控制需求,以风险收益比作为投资决策的重要参考指标,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。

公司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、权益、混合、量化、FOF、现金管理、股票质押式回购、资产证券化以及定向通道等品种。

此外,公司亦有新三板业务、场外市场业务等,并通过子公司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等业务。

(二) 行业情况说明

2017年,中国经济实现较快增长,GDP增速达6.9%,经济运行稳中向好、好于预期,供给侧结构性改革取得重要进展,经济结构不断优化,新旧动能的转换加快进行,新动能成为经济增长的重要动力,经济增长的质量和效益得到提升,经济活力、动力和潜力不断释放,稳定性、协调性和可持续性明显增强,实现了平稳健康发展。金融风险作为防范化解重大风险攻坚战的突出重点,防风险成为2017年全年金融政策主线,依法全面从严监管态势持续,在整治市场乱象、弥补制度短板、防范金融风险等方面取得了阶段性成效。

2017年,国内股市继续震荡上行,上证指数收于3,307.17点,上涨6.56%;深证成指收于11,040.45点,上涨8.48%。统计数据显示,131家证券公司合计实现营业收入3,113.28亿元,较上年同期下降5.08%;实现净利润1,129.95亿元,较上年同期下降8.47%。截至2017年12月31日,证券行业总资产6.14万亿元,净资产1.85万亿元,净资本1.58万亿元。

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 636.94 亿元，较年初下降 10.29%。其中，占总资产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 95.20%，变动情况如下表所示：

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	增减率(%)	情况说明
货币资金	13,408,192,597.14	18,127,955,171.10	-26.04	客户资金减少
结算备付金	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87	-29.43	客户备付金减少
融出资金	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04	8.98	两融规模增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	22,356,579,297.77	21,534,339,752.67	3.82	主要系股票投资增加
买入返售金融资产	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66	4.07	股票质押式回购规模增加
可供出售金融资产	8,859,087,222.71	11,632,792,839.82	-23.84	主要系投资的基金与理财产品减少
长期股权投资	1,648,571,467.49	1,621,964,192.55	1.64	投资银华基金确认的收益增加
固定资产	353,408,660.67	335,328,716.71	5.39	主要系购置房产
在建工程	340,110,741.83	285,779,102.36	19.01	增加公司江北嘴大楼投资

其中：境外资产 2,292,504,565.22（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 3.60%。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

（一）较强的综合金融服务能力

公司拥有经纪、投行、资管、投资等全业务牌照，控股西南期货、重庆 OTC，参股银华基金，并通过西证国际搭建境外上市金融平台（西证国际证券），构建了较为完整的综合业务平台，拥有境内外一体化服务实力，具备较强的综合金融服务能力。

（二）较强的体制机制竞争能力

公司坚持走市场化道路，高度重视人才梯队建设，在相关子企业积极开展职业经理人制度试点和员工持股计划试点，持续完善绩效考核机制和激励约束机制，不断优化人才结构，始终保持较强的体制机制竞争能力，确保公司平稳健康可持续发展。

（三）较强的地域优势及覆盖能力

公司总部位于重庆，作为西部大开发的重要战略支点、“一带一路”和长江经济带的联结节点，重庆综合经济实力在过去五年取得了较大提升，公司积极融入地方发展，加大服务地方实体经济，不断巩固地域市场优势。同时，公司拥有 128 家证券分支机构，覆盖全国 29 个省、直辖市及自治区上百万客户，已形成较为完备的业务网络体系。

第四节 经营情况讨论与分析

一、经营情况讨论与分析

2017 年，世界经济逐步向好，经济增长率明显回升，发达经济体经济持续增长，新兴市场和发展中经济体增长趋稳回升，但保护主义的不断升温、发达经济体货币政策的转向趋势以及经济发展的持续失衡，进一步增加了世界经济发展的不确定性。得益于供给侧结构性改革的不断推进，经济结构的不断优化，新旧动能的不断转换，中国经济仍然取得了较快增长。

2017 年，在防风险去杠杆的监管思路下，证券行业进一步加强规范性和合规性建设，全行业的规范程度不断得到提升；同时，伴随证券行业对外开放步伐的加快，行业竞争将进一步加剧，行业格局有望出现加速分化。

面对复杂的市场形势和依法全面从严的监管态势，公司不断强化内部管理，持续健全内控机制，稳步推进各项改革，确保经营管理工作有序开展，不断夯实各项业务的发展基础。

二、报告期内主要经营情况

报告期内，公司实现营业收入 30.61 亿元，同比下降 15.72%；净利润 6.91 亿元，同比下降 24.30%。截至 2017 年 12 月 31 日，公司资产总额 636.94 亿元，所有者权益总额 200.49 亿元，母公司净资产 143.51 亿元，每股收益 0.12 元。

(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	3,060,764,762.10	3,631,762,015.75	-15.72
营业成本	2,174,557,473.09	2,474,064,211.40	-12.11
管理费用	2,082,126,668.51	2,332,618,709.27	-10.74
经营活动产生的现金流量净额	-4,161,237,066.03	-10,615,695,542.55	
投资活动产生的现金流量净额	4,330,453,379.32	-363,605,565.48	
筹资活动产生的现金流量净额	-5,893,218,144.78	6,265,724,104.43	-194.05

1. 收入和成本分析

 适用 不适用

(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	1,334,402,079.09	871,933,610.68	34.66	-0.97	-9.39	增加 6.07 个百分点
证券自营业务	1,059,242,953.41	140,524,696.77	86.73	22.44	-36.33	增加 12.24 个百分点
投资银行业务	569,215,407.20	380,328,695.18	33.18	-53.34	-34.63	减少 19.13 个百分点
资产管理业务	108,721,079.03	99,121,812.87	8.83	-19.24	-17.85	减少 1.55 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	112,898,430.75	66,981,382.33	40.67	-18.49	10.31	减少 15.49 个百分点
华东	180,569,902.83	111,992,742.13	37.98	-18.51	9.99	减少 16.07 个百分点
中南	92,984,035.12	86,382,658.41	7.10	-19.15	-4.46	减少 14.29 个百分点
西南	2,529,755,675.00	1,764,290,700.74	30.26	-18.97	-12.31	减少 5.29 个百分点
西北	29,084,874.29	26,364,162.29	9.35	3.98	24.42	减少 14.89 个百分点
东北	5,838,112.38	11,645,473.92	-99.47	-40.66	-5.07	减少 74.77 个百分点
境外	109,633,731.73	106,900,353.27	2.49		-39.12	

主营业务分类别、分地区情况的说明

√适用 □不适用

1) 主营业务分类别情况的说明

证券经纪业务

在佣金和交易规模双降的压力下，公司经纪业务以合规风控为前提积蓄发展动力。截至 2017 年 12 月 31 日，公司证券分支机构为 128 家，客户总数 129.89 万户，同比增长 4.65%，股票基金交易金额市场份额 0.74%，排名 34 位；融资融券年日均余额市场份额 0.79%，期末余额市场份额 0.80%，排名 29 位，券源规模位居全国券商前列，融券余额市场排名 13 名；自有资金参与的股票质押融资业务日均余额同比增长 74.5%，在规模稳步增长的同时，通过做好贷前尽职调查、贷后盯市管理等风控工作，实现了全年项目安全零事故；金融产品销售方面，严格遵守客户适当性管理相关要求，优化产品结构，全年销量同比增长 41.95%，保有量同比增长 20%，产品表现良好，客户凝聚力开始回升。

公司经纪业务在互联网金融、财富管理、中间业务方面也取得进一步发展。通过对互联网证券业务框架的搭建和完善，在满足监管各项规定的前提下为客户提供更为便利、体验更佳的服务渠道；同时，推动投资顾问收费业务的不断探索，以提升客户收益率为目的，打造投资顾问在投资及咨询方面的核心竞争力；中间业务方面，培养综合专业素质人才，以经纪业务各地分支机构为触角，继续推进综合业务发展，做好中间业务的项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作，取得不错成效。

投资银行业务

2017 年度，随着宏观经济方面对传统产业去产能和供给侧结构性改革，证券监管部门进一步加强监管降风险的举措，对金融市场带来了深刻影响。投行业务总体呈现 A 股 IPO 市场继续保持强劲势头，并购重组市场适当放缓，债券市场扩容放慢，债券发行增速低于 2015 年及 2016 年的水平。

公司努力保持发挥大投行融合股权、债权、并购三大类的业务结构特点，加大债券产品和业务的开发力度，根据监管政策的导向，加大对绿色债和贫困地区企业发债的支持力度，完成绿色债发行 8 亿元，协助贫困地区融资 12 亿元，努力履行了自身社会责任。

2017 年公司因担任河南大有能源股份有限公司 2012 年非公开发行股票项目保荐人和鞍重股份 2016 年重大资产重组财务顾问，收到证监会两份行政处罚决定书。公司认真吸取教训，

以此为戒，查漏补缺，全面加强保荐业务管理和财务顾问业务的管理，加强持续督导工作和财务顾问业务风险管控能力，通过使用大数据信息化等各种手段，提高内部控制和风险管理水平。

股权融资业务：

报告期内，投行完成IPO项目2个，再融资项目7个，累计承销金额约129.46亿元。

2017 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	113,238.80	2
再融资发行	1,181,360.69	7
合计	1,294,599.49	9

债务融资业务：

2017年，债券市场增速减缓，保持平稳正常发展势头。报告期内，投行累计完成债券主承销发行项目22个、累计承销金额约164.64亿元。公司继续保持服务行业大客户的能力，成功的为中国铁路总公司、保定银行、珠海华润银行等国内大型客户承销发行债券。

2017 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	811,000.00	12
公司债券	565,350.00	7
其他债券	270,000.00	3
合计	1,646,350.00	22

资产管理业务

2017年金融监管全面趋严，“一行三会”围绕中央供给侧改革和去杠杆的大政方针出台了一系列强有力的监管措施，对大资管行业产生了重大影响。在此背景下，公司资产管理业务深入贯彻监管精神，着力发展主动管理业务，回归资管本源，稳妥推进产品去杠杆，压缩通道业务规模，调整业务结构，进一步加大服务实体经济力度。截至2017年末，公司在运资产管理计划183只，母公司管理的资产管理计划167只，其中主动管理计划65只（包括集合资管计划、定向主动管理计划、专项资管计划），管理规模330.98亿元，同比增长23%，主动管理规模占母公司资管总规模的36%，较2016年同期提高11个百分点；定向通道产品102只，管理规模592.38亿元，同比下降28%，通道规模不断下降。2017年全年，母公司新设立各类型资产管理计划54只，新增管理规模242.53亿元，其中主动管理产品新增设立债券、量化、混合、资产支持专项计划等产品规模124.68亿元，产品类型不断丰富，形成了以债券型产品为主、多品种同步发展主动管理业务格局。通道产品新增设立投向PPP、股票质押式回购等资产的产品规模逾100亿，通道业务结构不断优化，进一步服务实体经济发展。

证券自营业务

2017年，全球主要经济体复苏势头强劲，GDP增长和就业数据整体趋势向好，通胀维持低位；我国经济发展总体平稳，稳中有进，经济增长展现较强韧性，经济转型结构优化，世界影响力不断扩大。A股市场区间窄幅震荡上行，内部结构分化，以沪深300为代表的价值

股表现良好，中小市值、绩差股估值普遍下滑。公司自营业务部门梳理、修订、新建了较为完整的制度体系，严格遵章守法，规范投资，不断壮大投资研究团队，逐步打造投资核心竞争力，建立净值回撤控制机制，审时度势，稳中求胜。秉承价值投资理念，自上而下挑选景气向上的行业，自下而上研究公司基本面挑选投资标的，理性投资，控制了风险，把握了市场结构性机会，获得了较好的投资回报。量化投资业务继续坚持以绝对收益为核心，多策略、多品种、全市场的多元化投资理念，以量化交易为工具，灵活运用各种金融工具及衍生品进行风险管理，有效分散了投资风险，丰富了收益来源。目前已开展的业务和策略包括：固定收益策略、利率互换及国债期货套保、多因子及量化基本面、商品策略、期权策略、及多品种套利策略等。2017 年量化投资业务降低了债券持仓久期及杠杆，并转换了股票持仓的整体价值风格，持续为公司创造了稳定的绝对收益。

其他业务

公司新三板业务当年新增挂牌家数 57 家，市场排名第 13 位；累计督导企业家数 273 家，市场排名居第 12 位，市场份额占比 2.3%（市场排名根据 wind 数据统计）；协助 62 家挂牌企业进行股票发行融资共计 67 次，发行金额合计 34 亿元，发行业务收入占比不断提高；新三板托管账户达到 2,106 户，托管股份 72.2 亿股，托管市值达到 247 亿元，受托新三板股票资产继续保持稳定；做市业务主动进行策略调整，有效抑制了业务风险。场外业务启动场外衍生品交易，较短时间即成功落地场外期权合约共 5 笔（均为 SAC 主协议及补充协议项下的交易）；全年累计发行保本型固定收益凭证和浮动型收益凭证共 17 只，募集规模约为 39.3 亿元。研究发展中心投资研究能力持续增强，卖方服务的竞争力显著提升，投研佣金连续三年保持较快增长；品牌影响力不断提升，医药团队先后斩获“新财富最佳分析师第四名”、“水晶球最佳分析师公募榜单第四名”、“2017 首届中国证券分析师金翼奖”，食品饮料团队获“水晶球最佳分析师总榜单第五名、公募榜单第一名”，计算机团队获“水晶球最佳分析师公募榜单第二名”，另有传媒团队在“天眼最佳选股分析师”评选中荣登传媒行业榜首。

西证投资新增投资项目 1 个，实现 5 个项目的退出，其中瑞斯康达项目实现 A 股 IPO 上市，奇虎 360 借壳江南嘉捷顺利完成。西证创新积极探索另类投资方向，深入挖掘企业孵化、成长、上市过程中的股权投资机会，持续拓展主题基金、MOM、港股通投资，积极探索不良资产、核心资产投资。西南期货深化业务创新，全年经营业绩再度实现逆势大幅增长，商品期货经纪业务同比增长 49%，客户发行期货资管计划 37 只，管理规模突破 10 亿元，并先后获得“中国最受欢迎期货公司”、“最具成长性会员”等殊荣；同时获批设立风险管理子公司，成为目前西部地区唯一一家四项基础业务资格齐备的风险管理子公司。重庆股转中心进一步完善企业孵化培育体系，形成“一市三板”的挂牌服务架构，力助中小微企业拓宽融资渠道，2017 年共协助挂牌企业完成定向增发 23.27 亿元，为企业办理股权质押融资 32.22 亿元，累计达 239.9 亿元，位居全国前列。

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	2017 年		2016 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	82,905,277.99	8	99,865,123.05	-16.98
广东	5	56,048,164.26	5	69,586,708.02	-19.46
江苏	6	26,020,791.14	6	33,398,063.07	-22.09
广西	2	1,933,087.56	2	3,820,560.82	-49.40
山东	2	9,568,708.09	2	11,559,321.68	-17.22
山西	3	13,986,319.07	3	17,788,903.85	-21.38
陕西	2	8,211,395.68	2	6,315,293.28	30.02
上海	4	68,106,685.82	4	78,287,675.65	-13.00
四川	6	34,432,843.03	6	42,990,754.30	-19.91
贵州	1	1,219,380.47	1	1,096,856.19	11.17
云南	4	15,023,889.21	4	20,649,152.97	-27.24
浙江	9	59,497,017.25	9	76,874,585.69	-22.61
重庆	44	383,105,220.62	44	508,825,445.08	-24.71
甘肃	1	10,184,920.54	1	12,825,084.27	-20.59
河北	2	12,144,973.33	2	13,744,680.00	-11.64
湖南	5	15,555,192.76	5	17,246,246.96	-9.81
福建	2	10,731,169.64	2	13,471,157.47	-20.34
湖北	2	9,211,900.30	2	12,107,803.94	-23.92
安徽	3	4,761,011.46	3	6,025,926.53	-20.99
青海	1	3,145,051.31	1	2,529,412.14	24.34
辽宁	2	2,972,206.44	2	4,299,215.44	-30.87
天津	1	930,355.84	1	976,250.76	-4.70
吉林	1	1,575,508.29	1	3,714,601.31	-57.59
内蒙古	2	2,931,504.52	2	6,133,737.11	-52.21
宁夏	2	5,060,710.07	2	6,086,879.58	-16.86
河南	5	10,235,690.24	5	12,250,795.44	-16.45
黑龙江	1	1,290,397.65	1	1,824,047.12	-29.26
江西	1	1,884,519.43	1	1,967,826.10	-4.23
新疆	1	2,482,796.69	1	213,627.39	1,062.21
境外		109,633,731.73		-2,968,663.43	
公司本部		2,095,974,341.67		2,548,254,943.97	-17.75
合计	128	3,060,764,762.10	128	3,631,762,015.75	-15.72

② 营业利润地区分部报告

单位：元 币种：人民币

地区	2017 年	2016 年	营业利润增
----	--------	--------	-------

	分支机 构数量	营业利润	分支机 构数量	营业利润	减百分比(%)
北京	8	41,609,719.08	8	64,512,920.77	-35.50
广东	5	10,981,657.70	5	22,184,780.07	-50.50
江苏	6	3,933,447.41	6	13,251,023.43	-70.32
广西	2	-2,842,482.39	2	-2,186,019.01	
山东	2	2,384,910.36	2	3,099,099.22	-23.05
山西	3	4,008,480.02	3	6,885,991.43	-41.79
陕西	2	-2,656,676.12	2	-2,800,160.04	
上海	4	41,170,383.92	4	54,407,091.17	-24.33
四川	6	15,217,186.69	6	23,853,737.73	-36.21
贵州	1	-554,095.88	1	-802,879.54	
云南	4	4,274,317.20	4	10,073,759.62	-57.57
浙江	9	24,683,452.92	9	47,190,936.37	-47.69
重庆	44	258,967,036.38	44	394,699,034.84	-34.39
甘肃	1	7,268,213.16	1	7,579,214.26	-4.10
河北	2	4,368,603.35	2	7,364,873.24	-40.68
湖南	5	-2,203,347.09	5	-171,214.11	
福建	2	1,018,463.11	2	4,192,492.30	-75.71
湖北	2	856,554.31	2	3,139,711.20	-72.72
安徽	3	-3,624,243.88	3	-1,714,198.35	
青海	1	823,106.00	1	786,334.51	4.68
辽宁	2	-2,779,743.45	2	-1,010,457.69	
天津	1	-1,340,672.83	1	-1,481,263.58	
吉林	1	-1,622,306.46	1	-44,239.40	
内蒙古	2	-2,729,081.20	2	507,469.61	-637.78
宁夏	2	44,641.95	2	2,060,459.55	-97.83
河南	5	-191,005.82	5	1,628,621.77	-111.73
黑龙江	1	-1,405,311.63	1	-1,375,416.19	
江西	1	-989,253.14	1	-663,087.74	
新疆	1	-2,758,572.99	1	-845,373.99	
境外		2,733,378.46		-178,571,642.69	
公司本部		487,560,529.87		681,946,205.59	-28.50
合计	128	886,207,289.01	128	1,157,697,804.35	-23.45

(2) 产销量情况分析表

□适用 √不适用

(3) 成本分析表

单位：元

分类别情况						
分类别	成本构成项目	本期金额	本期占总成本比例(%)	上年同期金额	上年同期占总成本比例(%)	本期金额较上年同期变动比例(%)
证券经纪业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损	871,933,610.68	40.10	962,252,649.42	38.89	-9.39

	失、其他业务成本					
证券自营业务	业务及管理费、税金及附加、资产减值损失	140,524,696.77	6.46	220,700,427.82	8.92	-36.33
投资银行业务	业务及管理费、税金及附加	380,328,695.18	17.49	581,790,623.50	23.52	-34.63
资产管理业务	业务及管理费、税金及附加	99,121,812.87	4.56	120,656,988.61	4.88	-17.85

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 68、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 57.77 亿元。具体分析如下：

(1) 经营活动产生的现金净流出 41.61 亿元，主要流入项目为：收取利息、手续费及佣金的现金 41.86 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 7.66 亿元；主要流出项目为：支付利息、手续费及佣金的现金 12.03 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 15.37 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 10.51 亿元，代理买卖证券支付的现金净额 34.04 亿元，支付的各项税费 5.50 亿元，融出资金净增加额 7.22 亿元，支付的其他与经营活动有关的现金 6.62 亿元。

(2) 投资活动产生的现金净流入 43.30 亿元，主要流入项目为：收回投资收到的现金 38.93 亿元，取得投资收益收到的现金 6.25 亿元；主要流出项目为：投资支付现金 0.41 亿元，购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 1.51 亿元。

(3) 筹资活动产生的现金净流出 58.93 亿元，主要流入项目为：公司发行债券收到现金 38.71 亿元；主要流出项目为：偿还债务支付的现金 73.68 亿元，分配股利、利润或偿付利息支付的现金 13.34 亿元，支付其他与筹资活动有关的现金 10.62 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	13,408,192,597.14	21.05	18,127,955,171.10	25.53	-26.04	客户资金减少
结算备付金	2,535,032,483.51	3.98	3,592,111,154.87	5.06	-29.43	客户备付金减少
融出资金	8,763,744,996.81	13.76	8,041,862,035.04	11.33	8.98	两融规模增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	22,356,579,297.77	35.10	21,534,339,752.67	30.33	3.82	主要系股票投资增加
买入返售金融资产	3,065,297,010.00	4.81	2,945,409,505.66	4.15	4.07	股票质押式回购规模增加
存出保证金	307,274,690.77	0.48	625,158,757.97	0.88	-50.85	主要系期货保证金、履约保证金减少
可供出售金融资产	8,859,087,222.71	13.91	11,632,792,839.82	16.38	-23.84	主要系投资的基金与理财产品减少
长期股权投资	1,648,571,467.49	2.59	1,621,964,192.55	2.28	1.64	投资银华基金确认的收益增加
在建工程	340,110,741.83	0.53	285,779,102.36	0.40	19.01	增加公司江北嘴大楼投资
递延所得税资产	260,551,227.47	0.41	162,122,654.79	0.23	60.71	主要系应付职工薪酬暂时性差异部分产生的递延所得税资产增加
其他资产	740,750,566.12	1.16	733,221,648.33	1.03	1.03	主要为其他应收款
应付短期融资款	401,300,000.00	0.63	7,368,400,000.00	10.38	-94.55	偿还到期短期公司债
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	4,492,139,574.10	7.05	5,490,490,745.17	7.73	-18.18	本期并表结构化主体减少
代理买卖证券款	9,887,672,483.98	15.52	13,292,127,523.64	18.72	-25.61	本期客户交易结算资金减少
应付职工薪酬	889,464,403.44	1.40	1,000,181,468.37	1.41	-11.07	本期计提职工薪酬减少
预计负债			64,180,032.69	0.09	-100.00	诉讼赔偿履行完毕
应付债券	16,953,849,842.62	26.62	13,447,553,351.21	18.94	26.07	本期发行的收益凭证增加
递延所得税负债	118,844,992.53	0.19	8,239,428.84	0.01	1,342.39	可供出售金融资产浮盈所致
其他负债	553,940,916.13	0.87	155,743,389.49	0.22	255.68	其他应付款增加

其他说明

(1) 资产情况

报告期末，公司资产总额为 636.94 亿元，较上期末减少 10.29%。其中，货币资金与结算备付金共 159.43 亿元，占总资产的比重为 25.03%，较上期末减少 26.60%；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 312.16 亿元，占总资产的比重为 49.01%，较上期末减少 5.88%；融出资金为 87.64 亿元，占总资产的比重为 13.76%，较上期末增加 8.98%；买入返售金融资产期末余额为 30.65 亿元，占总资产的比重为 4.81%，较上期末增加 4.07%；长期股权投资期末余额为 16.49 亿元，占总资产的比重为 2.59%，较

上期末增加 1.64%。从资产流动性来看，公司流动资产为 509.99 亿元，占总资产的比重为 80.07%，说明公司资产流动性充足。

(2) 负债情况

报告期末，公司负债总额为 436.46 亿元，较上期末下降 14.97%。其中，应付短期融资款与应付债券共 173.55 亿元，占负债总额的比重为 39.76%，较上期末下降 16.63%，主要系部分短期公司债到期；代理买卖证券款为 98.88 亿元，占负债总额的比重为 22.65%，较上期末减少 25.61%，主要为客户交易结算金减少；卖出回购金融资产款为 98.18 亿元，占负债总额的比重为 22.50%，较上期末增加 1.42%；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债为 44.92 亿元，占负债总额的比重为 10.29%，较上期末减少 18.18%，主要系合并的结构化主体减少。扣除代理买卖证券款后，公司自有负债总额为 337.58 亿元，资产负债率为 62.74%，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	7,202,817,136.84	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	120,771,261.92	停牌股票
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,601,328.60	融出证券
可供出售金融资产	53,837,432.42	融出证券
可供出售金融资产	45,423,277.98	停牌股票
可供出售金融资产	354,985,014.39	限售股
融出资金	2,983,914,553.35	用作卖出回购金融资产抵押物
合 计	10,763,350,005.50	

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 16.49 亿元，较年初增加 0.27 亿元，增幅 1.64%。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 54,331,639.47 元，累计投资额 340,110,741.83 元，工程累计投入占预算比例 30.10%。

(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	公允价值变动损益	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	22,504,143,764.44	22,356,579,297.77	822,239,545.10	-159,691,435.12	918,056,675.65
可供出售金融资产	7,800,111,924.28	8,229,022,945.84	-2,647,562,521.15		924,432,667.76
衍生金融工具		-68,737,082.55		80,120,707.60	-42,570,172.53
合计	30,304,255,688.72	30,516,865,161.06	-1,825,322,976.05	-79,570,727.52	1,799,919,170.88

(六) 重大资产和股权出售
 适用 不适用

(七) 主要控股参股公司分析
 适用 不适用

1. 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。

截至 2017 年 12 月 31 日，西证投资总资产 125,383.07 万元，净资产 123,825.89 万元；报告期内实现营业收入 10,044.17 万元，净利润 2,430.41 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（实收资本 18 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。

截至 2017 年 12 月 31 日，西证创新总资产 240,585.23 万元，净资产 229,890.04 万元；报告期内实现营业收入 17,576.38 万元，亏损 2,260.63 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 2017 年 12 月 31 日，西南期货总资产 149,575.91 万元，净资产 53,623.80 万元；报告期内实现营业收入 8,287.45 万元、净利润 1,708.96 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。

西证国际下属西证国际证券，通过其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 2017 年 12 月 31 日，西证国际总资产 229,250.46 万元，净资产 66,165.71 万元；实现营业收入 10,963.37 万元，净利润 13.84 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 2017 年 12 月 31 日，重庆股份转让中心总资产 52,717.96 万元，净资产 26,071.33 万元；实现营业收入 6,844.88 万元，净利润 1,647.05 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 44.10% 股权，为其第一大股东。银华基金成立于 2001 年 5 月，现注册资本 22,220 万元人民币，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 2017 年 12 月 31 日，银华基金总资产 299,191.11 万元，净资产 218,721.83 万元；报告期内实现营业收入 165,760.15 万元，营业利润 53,718.97 万元，净利润 40,091.60 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 2 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、西南证券双喜汇鑫策略 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、西南证券双喜汇鑫光大 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜基金优选 1 号集合资产管理计划、西南证券新三板鑫瑞 1 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、西南证券双喜盛誉混合配置 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 2 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、西南证券双喜金债中银 1 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、西南证券双喜盛誉策略 2 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 号集合资管计划、西南证券盛誉瑞泽策略 1 号集合资产管理计划、西南期货志胜量化 1 号资产管理计划、西南期货金盛优选 1 号资产管理计划、西南期货金智益乾新价值 1 号资产管理计划、西南炫霆 2 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 CAT 量化 1 号资产管理计划、西南期货 CAT 量化 3 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、西南期货余粮套利对冲 1 号资产管理计划等 32 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）、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、西证渝富渝江四号私募证券投资基金、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

2018 年，是贯彻落实党的十九大精神的开局之年，是改革开放的 40 周年，是决胜全面建成小康社会、实施“十三五”规划承上启下的关键一年。2017 年年底召开的中央经济工作会议明确指出，中国特色社会主义进入了新时代，我国经济发展也进入了新时代，其基本特征就是我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段。

在推动高质量发展这一根本要求下，资本市场的发展方向更加清晰而坚定，各项改革将稳妥有序推进，证券行业经营将更加规范和专业，服务高质量发展的能力将持续提升。IPO 常态化和高标准审核将持续进行，退市制度将进一步完善，新三板改革流动性或将有实质性改善，多层次资本市场体系建设将进一步完善；资管新规将提升资产管理机构的主动管理能力，穿透式监管将进一步凸显价值投资理念；股指期货临时性限制措施有望继续放宽，债券

市场品种创新将继续推进，股指期货等多种金融衍生品有望推出，市场产品体系将进一步丰富；“债券通”范围和规模有望继续扩大，H股“全流通”试点将持续推广，“沪伦通”有待开启，境外投资将更加规范和便利，市场互联互通和双向开放机制将进一步丰富；外资持股比例上限放宽，金融科技将继续推进行业改革创新，市场竞争格局或面临重塑，新时代的证券行业将更加稳健、更加多元、更加富有竞争力。与此同时，控制和防范重大风险将依然是监管主旋律，2018年证券行业生态将得到进一步优化。

(二) 公司发展战略

√适用 □不适用

2018年，证券行业监管制度的进一步完善和业务的创新发展都将进入新的纪元，在这样的时代环境下，公司将继续坚持以客户为中心的经营宗旨和服务实体经济的重要导向，遵循和贯彻“坚持以人为本，坚持市场化道路，坚持创新发展，坚守合规底线和风控边界”四大指导方针，牢牢把握“一带一路”、西部大开发、长江经济带发展等重要战略发展机遇，基于自身条件，大力推动业务模式的转型和产品服务的创新，进一步完善综合金融服务模式，全面升级内部管理体系，统筹协调国内国际市场，力争早日成为“具备一流的创新意识、业务能力和管理水平的现代投资银行”。

(三) 经营计划

√适用 □不适用

2018年，公司将紧扣监管机构规定和要求，继续坚持“稳中求进”的工作总基调，深化经营管理模式改革，促进公司高效高质运转，进一步增强发展的安全性、稳定性、协调性和可持续性。公司将以业务为中心，实行内生式增长与外延式扩张并举，不断充实公司综合金融业务版图，做优做强主营业务，做精做好创新业务，进一步增强业务联动和业务合作，健全公司一站式、立体化、多维度的综合金融业务体系，全面提升业务能力和综合金融服务效益。公司将紧紧围绕服务实体经济的需要，深入挖潜，下沉重心，通过强化资本中介功能，发挥资本市场专业优势，积极融入中央和地方各类战略，不断为实体经济疏通血脉，力争在金融服务实体经济、支持实体经济转型升级方面取得更大的成效。

(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、合规风险、信息技术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，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的市场风险，所持金融资产公允价值波动较大，公司采用风险价值（VaR）等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，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、核心人员流失等给公司造成损失的风险；

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/定价错误导致公司遭受损失的风险；

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给公司造成损失的风险；

④外部风险，是指业务开展过程中由于外部人员和机构欺诈、监管规定的变化和政治因素等导致公司遭受损失的风险。

(5) 合规风险

合规风险是指证券公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规或准则，从而使证券公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。

公司通过建立切实可行的合规管理体系，实现对合规风险的有效识别、评估和管理，形成合规考核、培训等长效机制，为公司各项业务依法合规经营提供有效支持和监督。

(6) 信息技术风险

信息技术风险主要是指各种内、外部原因造成公司信息系统运行异常或者数据损毁、泄露，导致信息系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面不能持续保障交易与业务管理稳定、高效、安全地运行，从而给证券公司带来一定的损失的风险。

公司经纪业务、投行业务、资管业务等多项主要业务和中后台管理均高度依赖信息系统的支撑，信息系统已成为支撑公司各项业务运转的关键设施。公司信息系统涉及环节众多，并要求有较高的连续性保障，可能会面临软硬件故障、通讯线路故障等不可预料事件带来的风险隐患，进而影响公司的声誉和服务质量，甚至会带来经济损失和法律纠纷。

(7) 创新业务风险

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，创新业务风险存在风险类型新颖且复杂，风险点形式多样的特点，同时相应的风险管理流程、制度有待完善。在各项创新业务开展中，依然会面临市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等。限于规模体量较小，创新业务相对缺乏可以随时变现的市场环境，流动性风险更为突出。另外，某些创新产品定价和支付过程较为复杂，可能孕育较大的操作风险，这就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了更高的要求。

2. 已采取或拟采取的对策

随着行业创新发展及监管加强，风险管理理念持续深入，风险管理的深度和广度不断延伸，公司不断完善风险管理制度，建立覆盖各业务条线和各风险类型的风险管理体系，对抵御市场波动和持续稳健发展提供有力支撑。同时，修订后的《证券公司全面风险管理规范》提出了更为具体明确的操作规范，公司风险管理工作紧紧围绕落实全面风险管理规范要求开展。

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。进一步建立完善全面风险管理架构，明确董事会、监事会、经理层、首席风险官、内部审计以及全体员工的风险管理职责；对首席风险官任职条件提出包括专业背景和工作经验要求，增加对公司风险管理部门人员以及承担管理责任的业务部门风险管理

人员的配置需求，同时增加风险管理人员的工作经验要求。进一步建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，包括可操作的风险管理制度、健全的组织架构、可靠的风险管理信息技术系统、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。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保持在适当的范围之内。

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、止损线等措施进行前端控制；风险管理部门实时监控各项指标并在指标出现异常时及时预警提示。报告期内，公司进一步加强对权益和非权益类投资业务的风险管理，持续加大盘中、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。在原有风控指标和授权管理体系基础上，完善了包括风险偏好、风险容忍度、重大风险限额在内的一整套量化风险控制指标体系，并通过压力测试、敏感性分析等方法计量风险、评估承受能力、指导资源配置。

此外，公司建立 COMSTAR 债券风险管理系统，实现了对债券交易审批流程和重要风控指标的前端控制，满足了银行间债券交易风险场内化管理的需求。通过定期授权管理，促使业务部门逐步降低低等级债券投资持仓比例，同时采用自主开发的交易分析程序，定期对债券交易偏离估值、产品关联交易进行分析，确保债券交易业务规范开展。

同时，公司修订了《西南证券股份有限公司压力测试管理办法》，建立常态化的压力测试机制，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经营状况发生重大不利变化、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、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、司法追索等手段进行管理。报告期内，公司已建立交易对手的征信、授信评估流程和信用风险资产监控系统。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、风险评估报告等信用风险管理方法。

债券投资的信用风险管理以信用风险限额和内部评级为基础，分别从投资品种、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。公司已建立 COMSTAR 债券风险管理系统重点分析低等级债券持仓集中度、债券市场风险和信用风险、债券交易价格偏离估值、异常交易行为等指标和内容，定期对债券持仓信用风险进行汇总分析。

(3) 公司修订了《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，分别从流动性限额、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、回购等业务由资金部门集中管理，保障了公司具有充足的流动性。报告期内，进一步加强对流动性风险控制指标的监控和管理，梳理及测算公司各期限负债情况，建立公司资产与负债管理数据库，对流动性风控指标提前测算，对大笔的业务用资开展压力测试，保证了各项监管指标持续符合监管要求。公司流动性风险控制指标流动性覆盖率（LCR）和净稳定资金率（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，分别从内控机制、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管理办法和风险监控作业指导书，确保各个业务环节标准化，流程化，最大程度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，对关键业务数据实行双人复核。风险管理部门通过内控平台、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) 公司依照信息安全管理要求和行业监管要求，不断投入资金进行基础设施改造、设备更新和其他技术升级，并根据经营管理活动需要不断完善信息安全策略，不断健全内部控制管理机制，持续规范操作流程，加强合规风控管理，加大问责力度，进一步提高信息系统建设和运维的管理水平。定期进行桌面推演和实战演练，进一步完善和优化系统应急处置流程，全面分析和评估信息技术面临的各种风险，防范和避免各种信息技术风险的发生。修订和完善信息技术管理制度，加强人员培训，不断提升运维管理水平和应急处置能力。

(6) 公司严格遵守外部法律规定和监管要求, 不断强化制度建设、适当性管理、员工执业行为、反洗钱管理和隔离墙管理等各项合规管理工作。根据外部新规的变化公司全面修订了《西南证券股份有限公司合规管理制度》, 公司推崇全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础的理念, 倡导和推进合规文化建设, 培育全体工作人员的合规意识, 并采取有效措施保障合规管理人员职业荣誉感和专业化、职业化水平。建立了董事会及监事会、经理层及合规总监、合规部门和各部门、各分支机构、各层级子公司四级合规管理组织体系。

(7) 公司在资本实力、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, 并将创新业务纳入公司全面风险管理体系。所有创新业务方案需涵盖风险监控和预警机制、应急处置预案, 风险管理部门独立对创新业务风险进行识别和监测, 确保创新业务风险敞口在公司净资本和流动性水平可承受范围之内。此外, 公司还通过加强对创新业务的研究, 不断完善创新业务管理体系, 审慎确定各项创新业务风险容忍度和规模授权, 在有效控制风险的前提下促进创新业务发展。

3. 公司风险控制指标动态监控和补足机制

公司建立并执行风险控制指标的动态监控机制, 根据监管标准的调整及创新业务的开展情况, 持续升级和优化净资本系统, 按照新规每日计算各项风险控制指标, 按照预先设定的阈值和监控标准对风控指标进行自动预警。定期向监管部门报告风险控制指标数据和达标情况; 针对风控指标不利变动及超预警、超限情况及时向当地证监局报告基本情况、问题成因、解决措施等。报告期间完善修订了《净资本与风险控制指标监控实施细则》, 对净资本等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。

公司制订了《西南证券股份有限公司资本补充管理办法》, 完善了净资本补足机制。净资本补足途径包括但不限于限制资本占用程度高的业务发展; 采用风险缓释措施; 制定资本工具的类型、发行规模、发行市场、投资者群体、定价机制以及相关政策问题的解决方案等; 已发行资本工具附有减记或转股条款的, 根据约定或监管规定进行减记或转股; 调整资本补充期间分红政策, 根据需要暂缓、推迟或免除向股东分红。确保各项风险控制指标持续符合监管标准, 提高公司吸收损失和抵御风险的能力。报告期内, 公司经营风险控制可在可承受范围之内, 公司主要风险控制指标均符合监管要求, 未发生触及预警标准、不符合规定标准的情况。

(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，公司严格执行监管机构关于现金分红比例的相关规定，未对现金分红政策进行调整。

(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 (%)
2017 年	0	0.50	0	282,255,456.20	668,800,161.74	42.20
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

(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	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
		江北嘴集团				
		重庆高速				
		重庆水务资产				

(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

1. 2017年5月10日，财政部颁布了《关于印发修订〈企业会计准则第16号——政府补助〉的通知》（财会[2017]15号），自2017年6月12日起施行。根据上述会计准则的要求，公司对会计政策予以相应变更，并按以上文件规定的起始日开始执行上述会计准则。根据修订后的政府补助准则要求，公司对于与公司日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用，并在利润表中的“营业利润”项目之上单独列报“其他收益”项目，与公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。对2017年1月1日存在的政府补助采用未来适用法处理，对2017年1月1日至本准则施行日之间新增的政府补助根据本准则进行调整。本次会计政策变更不会对公司财务状况和经营成果产生重大影响。

2. 2017年4月28日，财政部制定了《企业会计准则第42号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》，自2017年5月28日起施行。根据上述会计准则的要求，公司对当前实行的持有待售、终止经营相关会计政策进行变更，并按以上文件规定的起始日开始执行上述会计准则。上述会计准则明确了持有待售的非流动资产、处置组和终止经营的适用范围，制定了统一的分类、计量和列报标准。本次会计政策变更不会对公司财务状况和经营成果产生重大影响。

有关内容及影响详见2017年10月31日、2017年12月26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《关于公司会计政策变更的公告》。

(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	5

	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 2017 年第二次临时股东大会审议通过《关于聘请公司 2017 年度审计中介机构的议案》及《关于聘请公司 2017 年内部控制审计机构的议案》，同意聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2017 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

(四) 其他说明

适用 不适用

1. 公司诉庄敏股票质押式回购交易纠纷案

2017 年 10 月 26 日，公司作为“西南证券鹏瑞 2 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划实际出资人委托，代表资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令被告庄敏偿还融资本金 7.41 亿元、偿还融资利息、支付违约金并承担案件全部费用；判令公司（代资管计划）对被告庄敏名下已出质给公司的股票享有优先受偿的权利。该案目前处在一审审理阶段。

2. 公司诉庄明、庄敏股票质押式回购交易纠纷案

2017 年 10 月 26 日，公司作为“西南证券鹏瑞 2 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划实际出资人委托，代表资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令被告庄明偿还融资本金 3.99 亿元、偿还融资利息、支付违约金并承担案件全部费用；判令公司（代资管计划）对被告庄明名下已出质给公司的股票享有优先受偿的权利；判令被告庄敏承担连带清偿责任。该案目前处在一审审理阶段。

上述两起案件，公司作为“西南证券鹏瑞 2 号定向资产管理计划”管理人，仅严格遵照委托人指令处理相关事务，案件的最终诉讼结果由委托人实际承受。

3. 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。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。

4. 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

公司全资子公司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。该案已进入执行程序，现已收回本金 1,003.42 万元。

5. 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

公司全资子公司重庆西证小额贷款有限公司 2016 年 7 月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 1000 万元、利息、罚息及复利。2016 年 9 月，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。该案已进入执行程序，现已收回本金 14.41 万元。

6. 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，公司收到该案一审民事判决书，判令公司

上海陆家嘴东路证券营业部支付抛售股票所得款及账户余额 19,137,895.2 元, 抛售股票损失款 15,469,889.5 元以及利息损失, 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, 二审维持原判。公司现已履行完毕。

7. 上海中经诉外高桥委托投资纠纷案

2017 年 11 月 27 日, 原告上海中经投资管理有限公司向上海市浦东新区人民法院起诉, 请求法院确认被告上海外高桥集团股份有限公司购买的相关股票为其所有并赔偿其损失 7,145 万余元。2018 年 1 月 29 日, 原告向法院申请将公司陆家嘴东路证券营业部列为第三人参加诉讼。该案目前处在一审审理阶段。

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

(一) 2017 年 5 月 15 日, 公司及河南大有能源股份有限公司 2012 年非公开发行股票项目及持续督导保荐代表人李阳、吕德富、梁俊收到中国证监会《行政处罚决定书》([2017]46 号), 中国证监会决定: 对公司责令改正, 给予警告, 没收业务收入 1,000 万元, 并处以 2,000 万元罚款; 对李阳、吕德富给予警告, 并分别处以 30 万元罚款; 对梁俊给予警告, 并处以 15 万元罚款。

(二) 2017 年 5 月 17 日, 公司及鞍山重型矿山机器股份有限公司 2016 年重大资产重组财务顾问主办人童星、朱正贵收到中国证监会《行政处罚决定书》([2017]54 号), 中国证监会决定: 责令公司改正, 没收业务收入 100 万元, 并处以 500 万元罚款; 对童星、朱正贵给予警告, 并分别处以 10 万元罚款。

(三) 2018 年 3 月 28 日, 公司公告收到中国证监会《行政监管措施决定书》([2018]58 号), 中国证监会决定通过其官方网站对公司予以公开谴责并责令公司改正。

有关内容及影响详见 2017 年 3 月 18 日、2017 年 5 月 6 日、2017 年 5 月 10 日、2017 年 5 月 16 日、2017 年 5 月 18 日、2018 年 1 月 30 日及 2018 年 3 月 28 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〉的公告》、《关于收到〈中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书〉的公告》、《关于收到〈中国证券监督管理委员会行政处罚决定书〉的公告》、《关于收到中国证券监督管理委员会监督管理措施事先告知书的公告》及《关于收到中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书的公告》。

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

报告期内，重庆渝富致函重庆 OTC，因监管等原因终止将其所持重庆 OTC 之 32% 股权转让予其股东重庆渝富控股集团有限公司。就上述所涉转让事项，公司曾于 2016 年经综合考虑不行使相关优先认购权。本次终止转让不会对公司当前持有重庆 OTC 股权产生影响。

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

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

结合公司对口重庆城口县扶贫工作实际，公司以重庆城口证券营业部为基础，于 2017 年 5 月正式组建西南证券城口金融扶贫工作站，主动与当地政府部门建立长效帮扶的协调联络机制，积极争取地方支持并对接城口县相关企业和扶贫项目。在西南证券城口金融扶贫工作站的协调下，公司已与当地国资平台——重庆市鹏欣国有资产投资经营有限公司签订了《战略合作协议》，有望为将来的对口扶贫工作带来联动效应。

公司在创造经济效益的同时，不忘承担社会责任，积极投身公益慈善事业。公司 2017 年向西部贫困地区及其他各类捐赠的扶贫资金共计 654.86 万元。其中，公司积极响应重庆市慈善总会的倡议，向市慈善总会捐款 15 万元人民币，用于开展慈善公益项目活动；向重庆市城口县捐赠 350 万元，用于扶贫开发项目；向西藏昌都市芒康县对口捐赠 180 万元人民币；向新疆麦盖提县捐赠扶贫资金 50 万元，并通过当地企业开展了 200 余万元的消费扶贫；向山西省隰县捐赠 30 万元用于隰县光伏贫困村电站建设。

公司在招聘工作中认真落实扶贫工作精神，在执行公司人才招聘标准的前提下，优先选拔录用来自贫困地区的高校毕业生。报告期内，公司定向接收新疆籍少数民族应届毕业生 2 人。

公司发挥专业优势，为贫困地区企业提供多元化的金融服务，正在推进多个贫困地区新三板挂牌、IPO、公司债发行等项目，积极谋划金融扶贫，推动贫困地区经济发展。公司派遣财经金融专家、行业研究员赴贫困地区举行资本市场知识讲座、专题报告会及现场互动交流等，为贫困地区的企业、金融单位和投资者普及大众金融知识。贫困县所在的营业部还组织对投资者开展反洗钱、非法集资、非法金融活动等多种形式的教育活动，加强贫困地区投资者风险防范意识，引导投资者形成科学理性的投资理念。

3. 精准扶贫成效

单位：万元 币种：人民币
数量及开展情况

指 标	数量及开展情况
-----	---------

一、总体情况	
其中：1. 资金	654.86
二、分项投入	
1. 社会扶贫	
其中：1.1 定点扶贫工作投入金额	350.00
2. 其他项目	
其中：2.1. 项目个数（个）	7
2.2. 投入金额	304.86

4. 后续精准扶贫计划

一是深入开展结对帮扶活动。加大对结对贫困县的帮扶力度，积极发挥金融扶贫工作站作用，根据项目情况注入投行、新三板、股权投资、小贷等相关服务资源，就金融扶贫、产业扶贫、人才招聘、投资者教育、企业治理结构规范等方面开展进一步合作，争取发挥公司的金融优势，有效带动地方经济快速发展。

二是多层次服务贫困地区拓宽融资渠道。公司将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，支持贫困地区增强自我发展能力。立足贫困地区资源禀赋和产业基础，积极探索产业扶贫、消费扶贫和公益扶贫，为当地企业和特色产业发展提供专业化的金融服务。

三是大力开展公益扶贫活动。积极响应国家关于教育扶贫的号召，通过捐赠学习用具、教育资金、生活用品等活动，帮助贫困地区解决实际教育困难，改善贫困地区办学条件，提升教育质量。积极参与公益捐赠慰问活动，组织公司志愿者参与扶贫服务工作。

(二) 社会责任工作情况

适用 不适用

报告期内，公司积极履行社会责任，有关情况详见 2018 年 3 月 31 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 2017 年度社会责任报告》。

(三) 环境信息情况

1. 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其重要子公司的环保情况说明

适用 不适用

2. 重点排污单位之外的公司

适用 不适用

公司一直倡导可持续发展的绿色办公理念，顺应低碳经济的发展要求，在尽可能降低自身运营对环境影响的同时，持续优化资源配置。公司持续推行网上交易，减少现场交易产生的相关物资消耗；优化升级 OA 系统，践行“无纸化”办公理念。同时，日常工作中，通过手机短信、电子邮件等方式向客户传递服务信息，大幅度减少了纸张、油墨、打印机及复印机耗材等使用，用实际行动支持环保事业。

3. 其他说明

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

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例（%）	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例（%）
一、有限售条件股份	1,000,000,000	17.71				-1,000,000,000	-1,000,000,000		
1、国家持股									
2、国有法人持股	1,000,000,000	17.71				-1,000,000,000	-1,000,000,000		
3、其他内资持股									
其中：境内非国有法人持股									
境内自然人持股									
4、外资持股									
其中：境外法人持股									
境外自然人持股									
二、无限售条件流通股份	4,645,109,124	82.29				1,000,000,000	1,000,000,000	5,645,109,124	100.00
1、人民币普通股	4,645,109,124	82.29				1,000,000,000	1,000,000,000	5,645,109,124	100.00
2、境内上市的外资股									
3、境外上市的外资股									
4、其他									
三、普通股股份总数	5,645,109,124	100.00						5,645,109,124	100.00

2. 普通股股份变动情况说明

 适用 不适用

公司经核准于 2014 年 2 月非公开发行的人民币普通股 50,000 万股，限售期为 36 个月；该等股票之后按公司 2015 年第四次临时股东大会审议通过的资本公积金转增股本方案所获转增的人民币普通股 50,000 万股一并限售。2017 年 2 月 24 日，上述 100,000 万股限售股份获准上市流通。

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

(二) 限售股份变动情况

 适用 不适用

单位：股

股东名称	年初限售股数	本年解除限售股数	本年增加限售股数	年末限售股数	限售原因	解除限售日期
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	300,000,000	300,000,000			认购公司非公开发行的	2017 年 2 月 24 日

重庆市城市建设投资(集团)有限公司	300,000,000	300,000,000			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。	2017 年 2 月 24 日
重庆高速公路集团有限公司	300,000,000	300,000,000				2017 年 2 月 24 日
重庆市水务资产经营有限公司	100,000,000	100,000,000				2017 年 2 月 24 日
合计	1,000,000,000	1,000,000,000			/	/

二、证券发行与上市情况

(一) 截至报告期内证券发行情况

√适用 □不适用

单位: 亿股 币种: 人民币

股票及其衍生证券的种类	发行日期	发行价格(或利率)	发行数量	上市日期	获准上市交易数量	交易终止日期
可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类						
次级债券	2017.12.21	6.27%	10	2018.01.10	10	2020.12.21

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

2017 年 10 月,公司收到上海证券交易所无异议函(上证函[2017]1092 号、上证函[2017]1093 号),上海证券交易所对公司非公开发行次级债券和证券公司短期公司债券挂牌转让无异议。其中,公司本次次级债券的拟发行金额为 60 亿元,公司非公开发行证券公司短期公司债券总额不超过 150 亿元,以上无异议函自出具之日起 12 个月内有效。据此,公司于报告期内非公开发行次级债券(第一期)合计 10 亿元,并于 2018 年 1 月 10 日起在上海证券交易所挂牌交易。

(二) 公司普通股股份总数及股东结构变动及公司资产和负债结构的变动情况

√适用 □不适用

报告期内,公司以去杠杆、控风险、紧盯市场为主要调整思路,主动调整资产负债结构,成效显著。本财年度,带息负债规模较上财年末大幅下降,公司去杠杆成效显著;应付债券中短期负债的比例大幅下降,以长期次级债替换短期负债,补充净资本的同时提升可用稳定资金,进一步加强了公司抗风险能力。

(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)	146,772
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	145,132

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

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称（全称）	报告期内增减	期末持股数量	比例（%）	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况		股东性质
					股份状态	数量	
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	0	无	0	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	0	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	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	-38,401,989	112,337,834	1.99	0	无	0	未知
招商财富—招商银行—渝富4号专项资产管理计划	0	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	0	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
中央汇金资产管理有限责任公司	0	62,392,600	1.11	0	无	0	国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
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				
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	400,500,000	人民币普通股	400,500,000				
中国建银投资有限责任公司	328,427,012	人民币普通股	328,427,012				
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	305,400,000	人民币普通股	305,400,000				
重庆高速公路集团有限公司	300,000,000	人民币普通股	300,000,000				
中国证券金融股份有限公司	112,337,834	人民币普通股	112,337,834				
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				
重庆市水务资产经营有限公司	100,000,000	人民币普通股	100,000,000				
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				
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中，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；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，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
(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	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

境内外上市公 司的股权情况	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	中交地产股份有限公司	000736	29,719	3,176	10.69%
	4	重庆农村商业银行股份有限公司	03618. HK	1,000,000	99,800	9.98%
	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	533,972	1,709	0.32%

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

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，重庆渝富控股集团有限公司持有重庆渝富 100% 股权。

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	56	2016.7.15	至今					32.14	否
李剑铭	董事	男	55	2014.1.27	至今						是
吴坚	董事	男	53	2016.8.3	至今					32.14	否
	总裁			2016.7.18							
张纯勇	董事	男	52	2017.3.21	至今					25.71	否
	副总裁			2009.2.15							
张刚	董事	男	54	2017.5.3	至今						是
万树斌	董事	男	54	2017.5.3	至今						是
赵如冰	独立董事	男	61	2017.5.3	至今					6.67	是
罗炜	独立董事	男	42	2017.5.3	至今					6.67	否
傅达清	独立董事	男	51	2017.5.3	至今					6.67	否
王珠林	原董事	男	53	2009.3.5	2017.3.21						是
江峡	原董事	女	49	2010.4.29	2017.3.21						是
吴军	原独立董事	男	64	2009.3.16	2017.5.3					3.33	否
刘轶茂	原独立董事	女	69	2012.11.30	2017.5.3					3.33	否
张力上	原独立董事	男	59	2013.7.31	2017.5.3					3.33	否
蒋辉	监事会主席	男	58	2010.9.28	至今					32.14	否
李波	监事	男	56	2017.5.3	至今					2.67	是
赵天才	职工监事	男	45	2017.5.3	至今					152.35	否
高文志	原监事	男	47	2009.2.15	2017.5.3					1.33	否
李波	原职工监事	男	49	2013.6.8	2017.5.3					124.16	否
李勇	副总裁、合规	男	51	2009.2.15	至今					25.71	否

	总监、首席风险官										
侯曦蒙	副总裁	女	47	2010.9.16	至今					25.71	否
蒲锐	副总裁	男	44	2015.4.30	至今					25.71	否
徐鸣镝	原副总裁、原董事会秘书	男	48	2009.2.15	2017.7.26					15.00	否
合计	/	/	/	/	/				/	524.77	/

注：1. 公司董事长、监事会主席、高级管理人员 2017 年度的税前薪酬总额仍在确认过程中，待确认后再另行披露。

2. 徐鸣镝先生于 2017 年 7 月申请辞去副总裁、董事会秘书职务，上表中其薪酬为 2017 年 1-7 月任职期间获得报酬。

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，重庆市第五届政协常委、政协经济委员会副主任。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；第十二届全国人大代表。
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。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局办公室副主任；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；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。
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；银华基金管理股份有限公司董事；重庆仲裁委仲裁员；上交所第四届理事会会员自律管理委员会委员；中国证券业协会投资银行专业委员会委员。吴坚先生曾任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；重庆上市公司董事长协会秘书长；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；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。
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。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；西南期货有限公司董事长。
张刚	大学本科学历，高级经济师，中共党员，现任公司董事，重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司财务总监、董事、党委委员。张刚先生曾在中国农业银行、中国长城信托投资公司、银河证券、亚洲证券等单位工作，先后任重庆渝富资产管理集团有限公司办公室主任、总经理

	助理（兼办公室主任）；重庆城市公共交通站场集团有限公司党委委员、副总经理等职务。
万树斌	大学本科学历，中共党员，现任公司董事，建投华文投资有限责任公司纪委书记、监事长。万树斌先生曾任中国建设银行会计部财务处副处长，计财部购建处副处长、处长，资债部利率处高级经理；中国建银投资有限责任公司财务会计部副总经理、业务总监；中投科信科技股份有限公司党委副书记、董事、总经理；中国建银投资有限责任公司集中采购办公室负责人、资产管理分公司副总经理、财务资金部业务总监、风险管理部总经理。
赵如冰	金融学硕士，研究员级高级工程师，中共党员，现任公司独立董事，阳光资产管理股份有限公司副董事长。赵如冰先生曾任葛洲坝水力发电厂主任；葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站站长、书记；葛洲坝水力发电厂办公室主任兼外办主任；华能南方开发公司党组书记、总经理；华能房地产开发公司党组书记、总经理；长城证券有限责任公司董事、副董事长、党委副书记；景顺长城基金管理有限公司董事长。
罗炜	会计学博士，中共党员，现任公司独立董事，北京大学光华管理学院会计学系副教授、副系主任，新晨科技股份有限公司独立董事、华油惠博普科技股份有限公司独立董事。罗炜先生曾任中南财经大学会计学院助教；北京大学光华管理学院会计系助理教授（讲师）；北京数字认证股份有限公司独立董事、北京汇冠新技术股份有限公司独立董事。
傅达清	法学硕士，现任公司独立董事，泰和泰律师事务所律师，重庆粮食集团有限责任公司外部董事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。傅达清先生曾任重庆工商大学英语讲师；重庆渝和律师事务所律师；重庆城市交通开发投资（集团）有限公司外部董事。
王珠林	经济学博士，中共党员，报告期曾任公司董事、党委委员，现任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，中国航发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，北汽福田汽车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；银华基金管理有限公司副董事长；重庆市证券期货业协会会长。
江峡	硕士研究生，中共党员，报告期曾任公司董事，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，报告期曾任公司独立董事，现任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，报告期曾任公司独立董事。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	经济学硕士，会计学教授，中国注册会计师非执业会员，报告期曾任公司独立董事。张力上先生于 1982 年参加工作，曾任西南财经大学会计学院教授委员会主席，会计系主任；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；宜宾五粮液股份有限公司、吉峰农机连锁股份有限公司、成都卫士通信息产业股份有限公司、四川科新机电股份有限公司等公司独立董事。
蒋辉	经济学博士、博士后，中共党员，现任公司监事会主席。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负责

	人、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，中国证监会重庆办事处副主任、党委委员、上市公司监管处处长，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。
李波	硕士，会计师，中共党员，现任公司监事，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，兼重庆金融后援服务有限公司董事、重庆兴农融资担保集团有限公司董事。李波先生曾任四川省重庆市巴县二轻工业局计财股办事员、计财股副股长；四川省重庆市市中区财政局科员、预算科副科长、主任科员；四川省重庆市渝中区财政局预算科科长；四川省重庆市渝中区财政局副局长；重庆市渝中区财政局副局长，局长、党组书记；重庆市渝中区金融工作办公室主任（兼）；重庆市渝中区人大常委会副主任；重庆市城市建设投资（集团）有限公司财务总监、党委委员，财务总监、党委委员、董事，党委副书记、总经理、董事。
赵天才	计算机硕士、工商管理硕士，现任公司监事，公司风险控制部总经理。赵天才先生曾任西南大学图书馆系统管理员，重庆有价证券公司营业部系统管理员，西南证券有限责任公司重庆胜利路证券营业部交易主管、徐州淮海西路证券营业部业务总监、风险管理部总经理助理、合规与风险管理部总经理助理，西南证券股份有限公司合规与风险管理部总经理助理、风险控制部副总经理。
高文志	博士，中共党员，报告期曾任公司监事，现任深圳市招商平安资产管理有限责任公司投资银行部总经理。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；平安信托有限责任公司北京区域事业群事业三部总监。
李波	本科学历，中共党员，会计师、高级审计师，报告期曾任公司职工监事，现任公司审计部总经理、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。
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；中国证券监督管理委员会重庆监管局上市处副处长；重庆国际信托投资有限公司（现重庆国际信托股份有限公司）党委委员、工会主席兼综合管理部总经理；西南证券有限责任公司办公室主任、副总裁、合规总监；西证股权投资有限公司董事；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。
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，曾任西南证券有限责任公司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，公司总裁办公室主任；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；中国证券监督管理委员会成都证管办上市公司监管处副处长；中国证券监督管理委员会四川证监局上市公司监管一处副处长；中国证券监督管理委员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）；中国证券监督管理委员会四川监管局稽查二处处长；公司总裁助理。
徐鸣镛	硕士，注册会计师，中共党员，报告期曾任公司副总裁、董事会秘书、党委委员。徐鸣镛先生于 1991 年参加工作，曾任黑龙江会计师事务所证券部副经理；中国证券监督管理委员会主任科员；西南证券有限责任公司总裁助理、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。

其它情况说明

√适用 □不适用

1. 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。

2. 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。

3. 2017 年 7 月 26 日，公司收到副总裁兼董事会秘书徐鸣镝先生的书面辞职申请，因个人原因，徐鸣镝先生申请辞去在公司所担任的上述职务。

有关内容详见 2017 年 3 月 2 日、3 月 23 日、7 月 27 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《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》、《关于副总裁兼董事会秘书辞职的公告》。

(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	重庆渝富资产管理集团有限公司	董事长、党委书记	2013 年 9 月	至今
张刚	重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	财务总监、董事、党委委员	2012 年 4 月	至今
万树斌	中国建银投资有限责任公司	风险管理部总经理	2014 年 7 月	2018 年 2 月
李波	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	2016 年 3 月	至今
在股东单位任职情况的说明				

(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
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	2017年9月
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	2017年9月
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	西证国际证券股份有限公司	董事会主席	2016年11月	至今
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
张纯勇	西南期货有限公司	董事长	2013年12月	2017年8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
万树斌	建投华文投资有限责任公司	纪委书记、监事长	2018年2月	至今
赵如冰	阳光资产管理股份有限公司	副董事长	2016年7月	至今
罗炜	北京大学光华管理学院	会计学系副教授、副系主任	2011年8月	至今
罗炜	新晨科技股份有限公司	独立董事	2015年9月	至今
罗炜	华油惠博普科技股份有限公司	独立董事	2016年11月	至今
罗炜	北京数字认证股份有限公司	独立董事	2012年6月	2017年9月
罗炜	北京汇冠新技术股份有限公司	独立董事	2015年9月	2017年12月
傅达清	泰和泰律师事务所	律师	2015年10月	至今
傅达清	重庆粮食集团有限责任公司	外部董事	2014年12月	至今
王珠林	银华基金管理股份有限公司	董事长	2012年7月	至今
王珠林	中证机构间报价系统股份有限公司	董事	2013年2月	至今
王珠林	中国航发动力股份有限公司	独立董事	2015年4月	至今
王珠林	中国中材股份有限公司	独立董事	2016年7月	至今

王珠林	北汽福田汽车股份有限公司	独立董事	2017 年 9 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	2017 年 9 月
张力上	四川科新机电股份有限公司	独立董事	2014 年 10 月	2017 年 9 月
李波	重庆金融后援服务有限公司	董事	2014 年 8 月	至今
李波	重庆兴农融资担保集团有限公司	董事	2014 年 3 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	2017 年 12 月
高文志	深圳市招商平安资产管理有限责任公司	投资银行部总经理	2017 年 12 月	至今
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
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

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 524.77 万元。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	587.29 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
张纯勇	董事	选举
张刚	董事	选举
万树斌	董事	选举
赵如冰	独立董事	选举
罗炜	独立董事	选举
傅达清	独立董事	选举
王珠林	董事	离任
江峡	董事	离任
李波（注 1）	监事	选举
赵天才	职工监事	选举
吴军	独立董事	离任
刘轶茂	独立董事	离任
张力上	独立董事	离任
李波（注 2）	职工监事	离任
徐鸣镝	副总裁、董事会秘书	辞职

注 1：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

注 2：系公司第七届监事会职工监事，公司审计部总经理

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	2,545
主要子公司在职员工的数量	361
在职员工的数量合计	2,906
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	300
证券投资事业部	33
资产管理事业部	97
投资银行事业部	247
经纪业务事业部	1,665
新三板业务部	69
场外业务部	19
机构客户部	32
研究发展中心	77
主要子公司	361
其他	6
合计	2,906
教育程度	
教育程度类别	数量(人)
博士研究生	39
硕士研究生	986
大学本科	1,628
大专及以下	253
合计	2,906

(二) 薪酬政策

适用 不适用

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

2017 年公司培训工作紧密围绕经营发展战略目标，以坚持服务业务发展为中心，以全面提高员工素质为宗旨；以不断提升公司核心竞争力为目的，积极构建人才培养体系，不断完善各类人才培养措施，努力打造具有综合金融服务能力的专业化高素质人才队伍。新生力量培训常态化，着力引导新员工将个人优势、发展愿望与公司愿景目标有机结合；主力军培训多样化，着力提升业务骨干专业素养和综合能力，不断推动公司业务协同发展；中坚力量培训机制化，着力强化中层管理人员领导能力，拓宽业务视野，提高思维格局；西证星荟内

部讲师团培训品牌化，着力沉淀公司经验知识和优势资源，深入开展巡讲活动，积极支持重点区域开拓创新业务。

2018 年公司培训将以合规内控人才培养为重点，不断强化公司各业务线条的合规管理；以青年员工、业务骨干、中层管理人员等人才梯队培养为主线，提升员工综合业务技能和管理能力，支持培育业务增长点，持续促进业务稳定发展。

(四) 劳务外包情况

适用 不适用

七、其他

适用 不适用

截至 2017 年末，公司 128 家证券分支机构共有经纪人 1198 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，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

根据《公司法》、《证券法》及中国证监会等监管机构的规定和要求，公司建立了由股东大会、董事会、监事会和经理层组成的，相互分离、相互制衡的公司治理结构，各层级在职权范围内各司其职、各负其责，确保公司治理规范有效、决策科学。同时，公司制定并形成了以《公司章程》为核心，囊括《公司股东大会议事规则》、《公司董事会议事规则》、《公司监事会议事规则》、董事会各专门委员会工作细则以及《公司总裁工作细则》等的制度体系，并按照法律、法规和规范性文件的要求不断健全和完善各项制度，为公司的规范运作持续提供制度保证。

报告期内，公司董事会、监事会人数及人员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
2017 年第一次临时股东大会	2017 年 3 月 21 日	http://www.sse.com.cn	2017 年 3 月 23 日
2016 年度股东大会	2017 年 5 月 10 日	http://www.sse.com.cn	2017 年 5 月 11 日
2017 年第二次临时股东大会	2017 年 7 月 28 日	http://www.sse.com.cn	2017 年 7 月 29 日
2017 年第三次临时股东大会	2017 年 9 月 22 日	http://www.sse.com.cn	2017 年 9 月 23 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
		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	12	12	6	0	0	否	4
李剑铭	否	12	8	6	4	0	否	0
吴坚	否	12	12	6	0	0	否	3
张纯勇	否	9	8	4	1	0	否	1
张刚	否	6	6	3	0	0	否	0
万树斌	否	6	6	3	0	0	否	1
赵如冰	是	6	6	3	0	0	否	1
罗炜	是	6	6	3	0	0	否	0
傅达清	是	6	6	3	0	0	否	3

王珠林	否	3	3	2	0	0	否	0
江峡	否	3	2	2	1	0	否	0
吴军	是	6	6	2	0	0	否	1
刘轶茂	是	6	6	2	0	0	否	1
张力上	是	6	5	2	1	0	否	1

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

年内召开董事会会议次数	12
其中：现场会议次数	6
通讯方式召开会议次数	6
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

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。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《2017 年度内部控制评价报告》全文于 2018 年 3 月 31 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

根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日（2017年12月31日），不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷；根据公司非财务报告内部控制重大缺陷认定情况，于内部控制评价报告基准日，发现非财务报告内部控制存在两个重大缺陷。

报告期内公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制，报告期内公司对非财务报告内部控制方面存在的重大缺陷开展了有效整改工作。

(一) 重大缺陷发生的时间及具体情况

1. 2017年5月，中国证监会以在大有能源2012年非公开项目未勤勉尽责对公司出具《行政处罚决定书》，指出公司作为河南大有能源股份有限公司2012年非公开发行股票项目保荐人，存在项目尽职调查和持续督导过程中未勤勉尽职，致使公司出具的发行保荐书、持续督导报告等文件存在重大遗漏，违反《证券法》的相关规定。

2. 2017年5月，中国证监会以在鞍重股份2016年重大资产重组项目未勤勉尽责对公司出具《行政处罚决定书》，指出公司为鞍山重型矿山机器股份有限公司重大资产重组出具的独立财务顾问报告存在虚假记载、对重组标的公司九好集团的尽职调查过程中未勤勉尽责，违反《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》的有关规定。

(二) 缺陷对财务报告的影响

重大缺陷对公司的财务报告影响为：没收大有能源2012年非公开项目业务收入1,000万元，并处以2,000万元罚款；没收鞍重股份重大资产重组项目业务收入100万元，并处以500万元罚款。

(三) 整改措施

上述重大缺陷均为投资银行业务，为此公司正在对投资银行业务进行了全面整改，具体整改措施如下：

1. 公司一级部门内核部作为公司内核委员会的常设机构，与公司合规、风控部门一同构成投行类业务内部控制的第三道防线，实现公司层面对投行类业务风险的整体管控，其部门负责人为公司内核负责人；在投资银行事业部内成立合规部门，提升投资银行业务一线合规管理专业性与有效性。

2. 更新完善投资银行业务制度体系。

3. 建立完善投资银行业务绩效考核机制。

4. 对现有投资银行类项目开展了自查整改工作。

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 3 月 30 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

公司建立了董事会及监事会、经理层及合规总监、合规部门和各部门、各分支机构、各层级子公司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各部门、各分支机构、各层级子公司以及全体工作人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节。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，推行全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础的理念，进一步强化公司全员合规意识，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。

2017 年，根据中国证监会《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、中国证券业协会《证券公司合规管理实施指引》规定，公司从合规管理制度建设、人员配备、系统建设、履职保障等方面对合规管理机制进行了全面调整和完善。在合规管理制度建设方面，公司重新制定了基本制度——《西南证券股份有限公司合规管理制度》，并以此为基础建立完善了包括各项合规管理工作实施办法与操作流程在内的公司合规管理制度体系；在合规管理人员配备方面，公司严格根据监管要求，充实了公司合规管理部门专职合规管理人员，实现了公司各业务部门、各分支机构合规管理团队或专兼职合规经理的全覆盖，并向另类投资子公司、私募投资基金子公司选派了合规管理负责人，完善了公司合规管理组织体系；在合规管理系统方面，公司开发建设了合规管理新系统，进一步支持了信息隔离墙、员工执业行为管理以及合规考核、合规报告等合规工作的有效开展；在合规履职保障方面，公司积极支持合规总监、合规管理人员工作，充分保障其履职的独立性、知情权和调查权，并严格落实有关合规总监、合规管理人员薪酬待遇的监管规定。同时，公司以贯彻落实 3 号令为抓手，持续完善反洗钱工作机制，有效开展了健全架构、完善制度、更新系统、深化培训宣导等重点工作，促进了公司反洗钱水平的整体提升。

（二）稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

2017 年，公司审计部认真履行内审机构的职责，在充分揭示内控管理缺陷的同时，加强与管理层及被审单位的沟通，以达成对发现的问题和整改措施的共识。针对审计发现的问题，诸如，部分业务条线制度建设不完善、更新不及时、执行有瑕疵以及业务运行中的风险事项等，审计部共计提出了 305 条整改建议。整改建议均得到了被审单位的认同，绝大多数

发现的问题已完成整改；针对正在整改和尚未整改的问题，审计部将进行持续跟踪和督导；对已整改的问题，审计部亦将关注整改效果，切实履行审计促进公司完善治理的职能。

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. 2017 年 6 月 12 日,公司按时、足额支付了 2014 年公司债券 (第一期) 2016 年 6 月 10 日至 2017 年 6 月 9 日期间的利息,利率 4.10% (含税),总付息金额为 16,400.82 万元。

2. 2017 年 7 月 24 日,公司按时、足额支付了 2014 年公司债券 (第二期) 2016 年 7 月 23 日至 2017 年 7 月 22 日期间的利息,利率 3.67% (含税),总付息金额为 7,340.37 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。

4. 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。

5. 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。

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 号爱丽园公寓 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。2017 年 6 月 9 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 2017 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。

本期债券发行后，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	2017 年	2016 年	本期比上年同期增减 (%)	变动原因
息税折旧摊销前利润	1,731,403,485.18	2,041,327,643.15	-15.18	
流动比率	2.53	1.71	47.95	应付短期融资款下降
速动比率	2.53	1.71	47.95	应付短期融资款下降
资产负债率 (%)	62.74	65.92	减少 3.18 个百分点	
EBITDA 全部债务比	0.05	0.06	-16.67	
利息保障倍数	2.15	2.43	-11.52	
现金利息保障倍数	-4.65	-11.75	-60.43	主要系经营活动产生的现金净流出小于去年同期
EBITDA 利息保障倍数	2.36	2.60	-9.23	
贷款偿还率 (%)	100	100	0	
利息偿付率 (%)	100	100	0	

九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

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，与建设银行、农业银行、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 290.55 亿元人民币，尚未使用的授信额度为 185.83 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

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〔2018〕8-97号

西南证券股份有限公司全体股东：

一、审计意见

我们审计了西南证券股份有限公司（以下简称西南证券）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2017 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的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 2017 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2017 年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

二、形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西南证券，并履行了职业道德方面的其他责任。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、关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不对这些事项单独发表意见。

（一）融出资金、股权质押业务金融资产减值评估

1. 关键审计事项

详见本年度报告“第十一节 五、重要会计政策及会计估计 30. 融资融券业务、37. 买入返售与卖出回购款项的核算方法和七、合并财务报表项目注释 3. 融出资金、8、买入返售金融资产”。截至 2017 年 12 月 31 日，西南证券融出资金账面余额为 8,781 百万元，其减值准备余额为 17 百万元；股权质押业务金融资产账面余额为 1,791 百万元，其减值准备余额为 9 百万元。该类金融资产减值准备按照组合计提（就相同性质的金融资产而言）及按个别认定法（就重大金融资产而言）计提，管理层首先考虑该等金融资产是否有客观证据表明其存在减值迹象，之后管理层对于未发生减值部分执行组合减值评估。

由于融出资金和股权质押业务金融资产金额重大，且管理层需要作出重大判断，因此我们将融出资金和股权质押业务金融资产减值评估确定为关键审计事项。

2. 审计中的应对

我们针对融出资金、股权质押业务金融资产减值评估执行的主要审计程序包括：评估并测试个别及组合减值评估所涉及控制活动的设计的合理性及运行的有效性，包括对所使用的减值方法、数据源及减值结果的审批，对计算结果的复核以及对于相关负责人的监督；就组合评估而言，检查组合评估所用的模型及方法的适当性及一贯性、预估损失率的合理性等；重新计算组合准备以验证其准确性；对于报告期内组合评估政策的改变（如有），计算其影响程度并关注是否业经审批；就个别认定法，检查管理层用于计算单项减值损失的抵押资产的市场价值，对于股权质押式回购，重点关注抵押股票公允价值对本金的覆盖情况；获取管理层的评估记录及交易对手方资料，关注客户过往的还款历史，质押物的价值及流动性，进而综合判断管理层估计的合理性。

(二) 商誉和长期股权投资的减值评估

1. 关键审计事项

详见本年度报告“第十一节 五、重要会计政策及会计估计 18. 长期资产减值与七、合并财务报表项目注释 23. 商誉”。截止 2017 年 12 月 31 日，西南证券合并财务报表商誉账面余额为 295 百万元，其减值准备余额为 30 百万元；母公司财务报表长期股权投资账面余额为 5,888 百万元，其减值准备余额为 238 百万元。为评估商誉和长期股权投资的可回收金额，管理层委聘外部估值专家对可回收金额进行了评估；在确定是否应计提减值时涉及重大的管理层判断和估计，特别在预测未来现金流量方面包括对预测收入、长期平均增长率和利润率以及确定恰当的折现率所作的假设，这些关键假设具有固有不确定性且可能受到管理层偏向的影响。

由于合并财务报表商誉金额、母公司财务报表长期股权投资金额重大，且管理层需要作出重大判断和估计，因此我们将商誉和长期股权投资的减值确定为关键审计事项。

2. 审计中的应对

我们针对商誉和长期股权投资的减值评估执行的主要审计程序包括：评价商誉和长期股权投资减值测试关键假设的适当性；评价管理层委聘的外部估值专家的胜任能力、专业素质和客观性；评估商誉和长期股权投资减值测试的估值方法；评价在财务报表中有关商誉和对子公司投资的减值评估的披露是否符合企业会计准则的要求。

(三) 结构化主体合并范围

1. 关键审计事项

详见本年度报告“第十一节 十一、在其他主体中的权益”。截止 2017 年 12 月 31 日，西南证券纳入合并财务报表范围的结构化主体的资产总额为 7,013 百万元。

西南证券在开展业务的过程中管理和投资多项结构化主体。管理层需就是否对结构化主体存在控制，以确定结构化主体是否应纳入合并财务报表范围作出重大判断。在确定结构化主体是否纳入合并财务报表范围时，管理层对由西南证券担任管理人的结构化主体的权力进行评估，综合

考虑合并财务报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报或承担的风险敞口等因素评估西南证券从这些结构化主体中获取的可变回报以及权力与可变回报的联系。

2. 审计中的应对

我们针对结构化主体合并范围执行的主要审计程序包括：评估并测试管理层判断结构化主体是否纳入合并财务报表范围的内部控制的设计和执行的有效性；取得管理层认定的存在控制的结构化主体清单，抽样检查相关的资产管理合同、合伙协议和投资合同，结合交易各方背景、交易实质以及所产生的回报，评估西南证券对结构化主体的权力范围和对结构化主体承担或享有的可变回报权益以及权力与可变回报的联系；检查结构化主体风险和报酬的结构设计，包括在结构化主体中对任何资本或回报的担保、提供流动性支持的安排、佣金的支付以及收益的分配等，以评价管理层就西南证券因参与结构化主体的相关活动而拥有的对该主体的风险敞口、权力及对可变回报的影响所作的判断；获取管理层统计的未纳入合并财务报表范围的结构化主体中权益的情况。对于在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益，抽样检查金融资产投资合同并复核其初始投资成本及估值情况；对于在西南证券作为发起人但未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益，复核管理层统计的源数据，测试与资产管理业务有关的内部控制的设计和执行的有效性，并评估西南证券从这些结构化主体中获取的可变回报以及权力与可变回报的联系；评价财务报表中针对结构化主体的相关披露是否符合企业会计准则的要求。

四、其他信息

西南证券管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

五、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。

在编制财务报表时，管理层负责评估西南证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

西南证券治理层（以下简称治理层）负责监督西南证券的财务报告过程。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对西南证券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西南证券不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

(六) 就西南证券中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表审计意见。我们负责指导、监督和执行集团审计，并对审计意见承担全部责任。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施（如适用）。

从与治理层沟通过的事项中，我们确定哪些事项对本期财务报表审计最为重要，因而构成关键审计事项。我们在审计报告中描述这些事项，除非法律法规禁止公开披露这些事项，或在极少数情形下，如果合理预期在审计报告中沟通某事项造成的负面后果超过在公众利益方面产生的益处，我们确定不应在审计报告中沟通该事项。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：李 斌
（项目合伙人）

中国·杭州

中国注册会计师：何施岑

二〇一八年三月三十日

二、财务报表
合并资产负债表
 2017 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
资产：			
货币资金	1	13,408,192,597.14	18,127,955,171.10
其中：客户存款		8,239,064,307.99	11,177,627,392.18
结算备付金	2	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87
其中：客户备付金		2,359,593,605.12	3,031,028,158.89
融出资金	3	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	5	22,356,579,297.77	21,534,339,752.67
衍生金融资产	7		5,451,641.47
买入返售金融资产	8	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66
应收款项	9	50,247,697.25	197,767,003.24
应收利息	10	512,922,375.64	538,898,651.77
存出保证金	11	307,274,690.77	625,158,757.97
可供出售金融资产	14	8,859,087,222.71	11,632,792,839.82
持有至到期投资	15		99,441,565.00
长期股权投资	17	1,648,571,467.49	1,621,964,192.55
投资性房地产	18	39,205,355.22	42,692,703.64
固定资产	19	353,408,660.67	335,328,716.71
在建工程	20	340,110,741.83	285,779,102.36
无形资产	21	188,078,470.78	194,334,634.69
商誉	23	265,238,732.36	283,060,313.45
递延所得税资产	25	260,551,227.47	162,122,654.79
其他资产	26	740,750,566.12	733,221,648.33
资产总计		63,694,293,593.54	70,999,692,045.13
负债：			
应付短期融资款	29	401,300,000.00	7,368,400,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	31	4,492,139,574.10	5,490,490,745.17
衍生金融负债	7	68,737,082.55	179,666,955.88
卖出回购金融资产款	32	9,818,365,760.00	9,680,845,721.37
代理买卖证券款	33	9,887,672,483.98	13,292,127,523.64
应付职工薪酬	38	889,464,403.44	1,000,181,468.37
应交税费	39	120,281,692.80	163,708,384.51
应付款项	37	55,351,795.02	139,615,260.36
应付利息	40	285,683,496.85	341,155,812.48
预计负债	47		64,180,032.69
应付债券	43	16,953,849,842.62	13,447,553,351.21
递延所得税负债	25	118,844,992.53	8,239,428.84
其他负债	49	553,940,916.13	155,743,389.49
负债合计		43,645,632,040.02	51,331,908,074.01
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	51	5,645,109,124.00	5,645,109,124.00
资本公积	53	7,767,343,370.78	7,852,067,958.06
其他综合收益	55	405,525,788.48	42,534,694.42
盈余公积	57	1,009,845,259.83	926,129,306.65
一般风险准备	58	1,942,710,531.26	1,775,278,624.90
未分配利润	59	2,613,293,824.48	2,760,152,434.68
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		19,383,827,898.83	19,001,272,142.71
少数股东权益		664,833,654.69	666,511,828.41
所有者权益（或股东权益）合计		20,048,661,553.52	19,667,783,971.12
负债和所有者权益（或股东权益）总计		63,694,293,593.54	70,999,692,045.13

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

母公司资产负债表

2017 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
资产：			
货币资金		11,564,205,529.93	15,805,966,481.75
其中：客户存款		7,671,672,007.89	10,579,393,257.23
结算备付金		1,756,167,097.71	2,838,128,517.04
其中：客户备付金		1,642,906,995.19	2,304,085,573.98
融出资金		8,373,243,608.04	7,825,820,017.29
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		16,357,142,726.96	14,441,228,108.27
衍生金融资产			217,678.67
买入返售金融资产		2,131,464,220.86	2,533,907,230.66
应收款项	1	29,834,463.84	41,158,892.65
应收利息		368,053,966.18	365,204,205.21
存出保证金		210,277,112.72	435,801,325.60
可供出售金融资产		7,578,727,993.00	9,569,315,916.50
长期股权投资	2	5,649,737,822.29	5,623,130,547.35
投资性房地产		34,083,012.13	36,773,481.67
固定资产		342,651,847.91	319,545,862.08
在建工程		340,110,741.83	285,779,102.36
无形资产		181,680,019.53	188,290,057.14
递延所得税资产		186,428,656.17	114,127,098.09
其他资产	3	314,442,476.10	362,609,265.43
资产总计		55,418,251,295.20	60,787,003,787.76
负债：			
应付短期融资款		401,300,000.00	7,368,400,000.00
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		6,028,604.97	12,189,930.17
卖出回购金融资产款		9,818,365,760.00	8,939,845,721.37
代理买卖证券款		8,827,342,461.46	12,298,424,590.05
应付职工薪酬		747,733,009.70	920,304,584.29
应交税费		95,821,514.13	147,640,191.69
应付款项		28,514,553.44	64,873,035.07
应付利息		276,492,511.86	331,051,642.36
预计负债		7,456,000.00	71,636,032.69
应付债券		15,451,276,266.10	11,963,437,167.47
递延所得税负债		122,695,773.14	11,819,357.92
其他负债		514,907,202.43	106,970,597.32
负债合计		36,297,933,657.23	42,244,220,850.40
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		5,645,109,124.00	5,645,109,124.00
资本公积		7,767,998,295.28	7,852,722,882.56
其他综合收益		361,431,737.92	-28,178,930.61
盈余公积		1,009,845,259.83	926,129,306.65
一般风险准备		1,942,710,531.26	1,775,278,624.90
未分配利润		2,393,222,689.68	2,371,721,929.86
所有者权益（或股东权益）合计		19,120,317,637.97	18,542,782,937.36
负债和所有者权益（或股东权益）总计		55,418,251,295.20	60,787,003,787.76

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

合并利润表
 2017 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		3,060,764,762.10	3,631,762,015.75
手续费及佣金净收入	60	1,424,824,482.04	2,413,198,433.38
其中: 经纪业务手续费净收入		662,886,701.55	844,082,619.19
投资银行业务手续费净收入		626,183,734.90	1,367,740,095.65
资产管理业务手续费净收入		83,923,792.93	113,035,455.80
利息净收入	61	-217,510,672.53	34,370,191.52
投资收益(损失以“-”号填列)	62	1,999,857,981.16	1,370,586,687.23
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		192,997,852.10	151,874,016.03
资产处置收益(损失以“-”号填列)	63	-102,751.22	102,394.85
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	64	-77,136,428.06	-285,222,186.39
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-111,047,538.67	83,311,977.77
其他收益	65	17,702,396.26	
其他业务收入	66	24,177,293.12	15,414,517.39
二、营业支出		2,174,557,473.09	2,474,064,211.40
税金及附加	67	26,689,045.90	122,657,115.78
业务及管理费	68	2,082,126,668.51	2,332,618,709.27
资产减值损失	69	54,142,649.58	13,372,747.45
其他业务成本	70	11,599,109.10	5,415,638.90
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		886,207,289.01	1,157,697,804.35
加: 营业外收入	71	992,835.21	40,107,590.22
减: 营业外支出	72	44,562,877.78	71,274,616.49
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		842,637,246.44	1,126,530,778.08
减: 所得税费用	73	151,755,184.61	213,829,400.70
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		690,882,061.83	912,701,377.38
(一)按经营持续性分类		690,882,061.83	912,701,377.38
1.持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		690,882,061.83	912,701,377.38
(二)按所有权归属分类		690,882,061.83	912,701,377.38
1.少数股东损益		22,081,900.09	-4,871,351.62
2.归属于母公司股东的净利润		668,800,161.74	917,572,729.00
六、其他综合收益的税后净额		367,121,614.43	-179,319,796.13
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		362,991,094.06	-200,172,445.96
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益		5,028,993.04	-1,942,904.64
1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动		5,028,993.04	-1,942,904.64
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益		357,962,101.02	-198,229,541.32
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		-778,486.22	585,467.50
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		389,157,194.38	-201,072,466.88
3.外币财务报表折算差额		-30,416,607.14	43,247,882.08
4.其他			-40,990,424.02
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		4,130,520.37	20,852,649.83
七、综合收益总额		1,058,003,676.26	733,381,581.25
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,031,791,255.80	717,400,283.04
归属于少数股东的综合收益总额		26,212,420.46	15,981,298.21
八、每股收益:			
(一)基本每股收益(元/股)		0.12	0.16
(二)稀释每股收益(元/股)		0.12	0.16

法定代表人: 吴坚

主管会计工作负责人: 吴坚

会计机构负责人: 叶平

母公司利润表
 2017 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		2,841,959,621.56	3,447,450,040.70
手续费及佣金净收入	4	1,343,816,378.25	2,336,700,951.57
其中: 经纪业务手续费净收入		647,696,116.96	842,322,660.56
投资银行业务手续费净收入		576,308,217.22	1,325,077,663.50
资产管理业务手续费净收入		117,835,551.18	163,427,901.63
利息净收入	5	-10,737,198.36	-50,213,036.04
投资收益(损失以“-”号填列)	6	1,683,572,084.54	1,295,713,275.32
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		192,997,852.10	151,874,016.03
资产处置收益(损失以“-”号填列)		-97,330.67	102,394.85
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7	-197,048,321.94	-149,297,904.89
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-1,857,866.09	2,021,837.85
其他收益		2,436,796.26	
其他业务收入		21,875,079.57	12,422,522.04
二、营业支出		1,816,591,875.57	2,204,407,712.16
税金及附加		24,257,408.11	94,632,122.02
业务及管理费		1,712,722,610.40	2,040,891,852.82
资产减值损失		68,855,707.01	64,562,170.96
其他业务成本		10,756,150.05	4,321,566.36
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,025,367,745.99	1,243,042,328.54
加: 营业外收入		444,232.69	20,853,241.34
减: 营业外支出		44,156,590.04	78,215,974.27
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		981,655,388.64	1,185,679,595.61
减: 所得税费用		144,495,856.88	196,674,960.12
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		837,159,531.76	989,004,635.49
(一)持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		837,159,531.76	989,004,635.49
六、其他综合收益的税后净额		389,610,668.53	-240,231,953.90
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益		5,028,993.04	-1,942,904.64
1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动		5,028,993.04	-1,942,904.64
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益		384,581,675.49	-238,289,049.26
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		-778,486.22	585,467.50
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		385,360,161.71	-238,874,516.76
七、综合收益总额		1,226,770,200.29	748,772,681.59
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: 吴坚

会计机构负责人: 叶平

合并现金流量表
 2017 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、经营活动产生的现金流量：			
收取利息、手续费及佣金的现金		4,186,240,832.98	5,175,034,109.27
回购业务资金净增加额		137,520,038.63	
融出资金净减少额			2,070,006,536.57
收到其他与经营活动有关的现金	75	766,226,663.77	814,304,852.92
经营活动现金流入小计		5,089,987,535.38	8,059,345,498.76
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		1,051,411,244.03	5,150,483,739.47
融出资金净增加额		721,882,961.77	
代理买卖证券支付的现金净额		3,404,455,039.66	5,772,731,663.34
支付利息、手续费及佣金的现金		1,202,662,805.63	1,139,340,250.32
支付给职工以及为职工支付的现金		1,537,225,824.99	2,196,323,165.05
支付的各项税费		549,860,992.04	707,440,502.31
拆入资金净减少额			885,000,000.00
回购业务资金净减少额		121,909,448.30	2,126,046,201.04
支付其他与经营活动有关的现金	75	661,816,284.99	697,675,519.78
经营活动现金流出小计		9,251,224,601.41	18,675,041,041.31
经营活动产生的现金流量净额		-4,161,237,066.03	-10,615,695,542.55
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		3,893,253,820.85	712,511,533.28
取得投资收益收到的现金		625,196,094.23	488,820,833.61
收到其他与投资活动有关的现金	75	4,248,859.68	3,040,896.12
投资活动现金流入小计		4,522,698,774.76	1,204,373,263.01
投资支付的现金		41,128,478.44	1,332,840,730.44
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		151,116,917.00	235,138,098.05
投资活动现金流出小计		192,245,395.44	1,567,978,828.49
投资活动产生的现金流量净额		4,330,453,379.32	-363,605,565.48
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			102,710,262.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			102,710,262.00
发行债券收到的现金		3,871,300,000.00	18,068,400,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	75		1,742,919,848.94
筹资活动现金流入小计		3,871,300,000.00	19,914,030,110.94
偿还债务支付的现金		7,368,400,000.00	12,000,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,334,260,939.18	1,648,306,006.51
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		27,520,420.15	9,482,829.64
支付其他与筹资活动有关的现金	75	1,061,857,205.60	
筹资活动现金流出小计		9,764,518,144.78	13,648,306,006.51
筹资活动产生的现金流量净额		-5,893,218,144.78	6,265,724,104.43
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-52,839,413.83	54,839,526.49
五、现金及现金等价物净增加额		-5,776,841,245.32	-4,658,737,477.11
加：期初现金及现金等价物余额		21,720,066,325.97	26,378,803,803.08
六、期末现金及现金等价物余额		15,943,225,080.65	21,720,066,325.97

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

母公司现金流量表
 2017 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、经营活动产生的现金流量:			
收取利息、手续费及佣金的现金		3,572,636,165.10	4,135,043,135.37
回购业务资金净增加额		1,278,941,104.47	
融出资金净减少额			1,583,857,933.45
收到其他与经营活动有关的现金	8	654,883,895.15	912,516,750.34
经营活动现金流入小计		5,506,461,164.72	6,631,417,819.16
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		2,045,665,848.47	641,933,330.76
融出资金净增加额		547,423,590.75	
代理买卖证券支付的现金净额		3,471,082,128.59	5,572,570,636.75
支付利息、手续费及佣金的现金		851,069,143.14	1,084,401,000.28
支付给职工以及为职工支付的现金		1,332,305,279.18	1,989,637,021.94
支付的各项税费		522,275,415.02	627,701,851.87
拆入资金净减少额			885,000,000.00
回购业务资金净减少额			3,001,524,383.35
支付其他与经营活动有关的现金	9	545,330,708.04	260,569,162.73
经营活动现金流出小计		9,315,152,113.19	14,063,337,387.68
经营活动产生的现金流量净额		-3,808,690,948.47	-7,431,919,568.52
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资收到的现金		2,935,683,290.50	
取得投资收益收到的现金		468,410,109.01	615,796,549.34
收到其他与投资活动有关的现金	10	4,137,192.02	4,031,379.82
投资活动现金流入小计		3,408,230,591.53	619,827,929.16
投资支付的现金		29,851,265.42	1,471,597,111.41
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		136,892,865.98	222,931,105.50
投资活动现金流出小计		166,744,131.40	1,694,528,216.91
投资活动产生的现金流量净额		3,241,486,460.13	-1,074,700,287.75
三、筹资活动产生的现金流量:			
发行债券收到的现金		3,871,300,000.00	18,068,400,000.00
筹资活动现金流入小计		3,871,300,000.00	18,068,400,000.00
偿还债务支付的现金		7,368,400,000.00	12,000,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,251,026,201.69	1,505,031,448.81
筹资活动现金流出小计		8,619,426,201.69	13,505,031,448.81
筹资活动产生的现金流量净额		-4,748,126,201.69	4,563,368,551.19
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-8,391,681.12	12,113,314.86
五、现金及现金等价物净增加额		-5,323,722,371.15	-3,931,137,990.22
加: 期初现金及现金等价物余额		18,644,094,998.79	22,575,232,989.01
六、期末现金及现金等价物余额		13,320,372,627.64	18,644,094,998.79

法定代表人: 吴坚

主管会计工作负责人: 吴坚

会计机构负责人: 叶平

合并所有者权益变动表
 2017 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		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
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		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
三、本期增减变动金额(减少以“—”号填列)		-84,724,587.28		362,991,094.06		83,715,953.18	167,431,906.36	-146,858,610.20	-1,678,173.72	380,877,582.40
(一) 综合收益总额				362,991,094.06				668,800,161.74	26,212,420.46	1,058,003,676.26
(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						83,715,953.18	167,431,906.36	-815,658,771.94	-27,890,594.18	-592,401,506.58
1. 提取盈余公积						83,715,953.18		-83,715,953.18		
2. 提取一般风险准备							167,431,906.36	-167,431,906.36		
3. 对所有者(或股东)的分配								-564,510,912.40	-27,890,594.18	-592,401,506.58
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		-84,724,587.28								-84,724,587.28
四、本期期末余额	5,645,109,124.00	7,767,343,370.78		405,525,788.48		1,009,845,259.83	1,942,710,531.26	2,613,293,824.48	664,833,654.69	20,048,661,553.52

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	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

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

母公司所有者权益变动表
 2017 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		-28,178,930.61		926,129,306.65	1,775,278,624.90	2,371,721,929.86	18,542,782,937.36
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		-28,178,930.61		926,129,306.65	1,775,278,624.90	2,371,721,929.86	18,542,782,937.36
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)		-84,724,587.28		389,610,668.53		83,715,953.18	167,431,906.36	21,500,759.82	577,534,700.61
(一) 综合收益总额				389,610,668.53				837,159,531.76	1,226,770,200.29
(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						83,715,953.18	167,431,906.36	-815,658,771.94	-564,510,912.40
1. 提取盈余公积						83,715,953.18		-83,715,953.18	
2. 提取一般风险准备							167,431,906.36	-167,431,906.36	
3. 对所有者(或股东)的分配								-564,510,912.40	-564,510,912.40
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		-84,724,587.28							-84,724,587.28
四、本期期末余额	5,645,109,124.00	7,767,998,295.28		361,431,737.92		1,009,845,259.83	1,942,710,531.26	2,393,222,689.68	19,120,317,637.97

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	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
4. 其他									
(四)所有者权益内部结转									
1. 资本公积转增资本(或股本)									
2. 盈余公积转增资本(或股本)									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 其他									
(五)专项储备									
1. 本期提取									
2. 本期使用									
(六)其他									
四、本期期末余额	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

法定代表人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

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）批准，通过重庆长江水运股份有限公司重大资产重组及吸收合并西南证券有限责任公司，并依法承继西南证券有限责任公司的各项证券业务资格设立的上市证券公司。

西南证券有限责任公司是 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。2009 年 2 月，经中国证监会证监许可[2009]62 号文批复，重庆长江水运股份有限公司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证券有限责任公司，并依法承继西南证券有限责任公司的各项证券业务资格。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。

公司现持有统一社会信用代码为 91500000203291872B 的营业执照。截至 2017 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），均为无限售条件的流通股份。

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。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司拥有 5 家一级子公司，128 家证券分支机构；拥有员工 2906 人，其中高级管理人员 5 人。

本财务报表业经 2018 年 3 月 30 日公司第八届董事会第十一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，具体情况详见本财务报表附注合并范围的变更和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（一般指从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

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。

10. 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：① 按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》确定的金额；② 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

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

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

(3) 金融资产转移的确认依据和计量方法

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

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

两项金额的差额计入当期损益：1) 终止确认部分的账面价值；2) 终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

(4) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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

2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

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

(5) 金融资产的减值测试和减值准备计提方法

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

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

3) 可供出售金融资产

① 表明可供出售债务工具投资发生减值的客观证据包括：

- 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。

11. 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和无收款风险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。

12. 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存在共有的控制，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。

13. 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。

14. 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

15. 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。

16. 借款费用

适用 不适用

17. 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、软件、交易席位费等，按成本进行初始计量。

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

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

18. 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。

19. 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。

20. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

21. 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, 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。

22. 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。

23. 股份支付

适用 不适用

24. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

25. 回购本公司股份

适用 不适用

26. 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。

27. 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，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

(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。对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，难以区分与资产相关或与收益相关的，整体归类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成本费用或损失的，确认为递延收益，在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益或冲减相关成本；用于补偿已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益或冲减相关成本。

(3) 与公司日常经营活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

28. 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。

29. 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

30. 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。

31. 持有待售资产

适用 不适用

(1) 持有待售的非流动资产或处置组的分类

公司将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：1) 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；2) 出售极可能发生，即公司已经就出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。

公司专为转售而取得的非流动资产或处置组，在取得日满足“预计出售将在一年内完成”的条件，且短期（通常为 3 个月）内很可能满足持有待售类别的其他划分条件的，在取得日将其划分为持有待售类别。

因公司无法控制的下列原因之一，导致非关联方之间的交易未能在一年内完成，且公司仍然承诺出售非流动资产或处置组的，继续将非流动资产或处置组划分为持有待售类别：1) 买方或其他方意外设定导致出售延期的条件，公司针对这些条件已经及时采取行动，且预计能够自设定导致出售延期的条件起一年内顺利化解延期因素；2) 因发生罕见情况，导致持有待售的非流动资产或处置组未能在一年内完成出售，公司在最初一年内已经针对这些新情况采取必要措施且重新满足了持有待售类别的划分条件。

(2) 持有待售的非流动资产或处置组的计量

1) 初始计量和后续计量

初始计量和在资产负债表日重新计量持有待售的非流动资产或处置组时，其账面价值高于公允价值减去出售费用后的净额的，将账面价值减记至公允价值减去出售费用后的净额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提持有待售资产减值准备。

对于取得日划分为持有待售类别的非流动资产或处置组，在初始计量时比较假定其不划分为持有待售类别情况下的初始计量金额和公允价值减去出售费用后的净额，以两者孰低计量。除企业合并中取得的非流动资产或处置组外，由非流动资产或处置组以公允价值减去出售费用后的净额作为初始计量金额而产生的差额，计入当期损益。

对于持有待售的处置组确认的资产减值损失金额，先抵减处置组中商誉的账面价值，再

根据处置组中的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例抵减其账面价值。

持有待售的非流动资产或处置组中的非流动资产不计提折旧或摊销，持有待售的处置组中负债的利息和其他费用继续予以确认。

2) 资产减值损失转回的会计处理

后续资产负债表日持有待售的非流动资产公允价值减去出售费用后的净额增加的，以前减记的金额予以恢复，并在划分为持有待售类别后确认的资产减值损失金额内转回，转回金额计入当期损益。划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不转回。

后续资产负债表日持有待售的处置组公允价值减去出售费用后的净额增加的，以前减记的金额予以恢复，并在划分为持有待售类别后非流动资产确认的资产减值损失金额内转回，转回金额计入当期损益。已抵减的商誉账面价值，以及非流动资产在划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不转回。

持有待售的处置组确认的资产减值损失后续转回金额，根据处置组中除商誉外各项非流动资产账面价值所占比重，按比例增加其账面价值。

3) 不再继续划分为持有待售类别以及终止确认的会计处理

非流动资产或处置组因不再满足持有待售类别的划分条件而不再继续划分为持有待售类别或非流动资产从持有待售的处置组中移除时，按照以下两者孰低计量：① 划分为持有待售类别前的账面价值，按照假定不划分为持有待售类别情况下本应确认的折旧、摊销或减值等进行调整后的金额；② 可收回金额。

终止确认持有待售的非流动资产或处置组时，将尚未确认的利得或损失计入当期损益。

32. 资产证券化业务

适用 不适用

33. 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) 套期有效性能够可靠地计量；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。

34. 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。

35. 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。

36. 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。

37. 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。

38. 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。

39. 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。

40. 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。

41. 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。

42. 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金和交易风险准备金。

43. 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。

44. 终止经营的确认标准、会计处理方法

满足下列条件之一的、已经被处置或划分为持有待售类别且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单独的主要经营地区；
- （2）该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关联计划的一部分；
- （3）该组成部分是专为转售而取得的子公司。

45. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

46. 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

企业会计准则变化引起的会计政策变更

1) 本公司自 2017 年 5 月 28 日起执行财政部制定的《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》，自 2017 年 6 月 12 日起执行经修订的《企业会计准则第 16 号——政府补助》。本次会计政策变更采用未来适用法处理。

2) 本公司编制 2017 年度报表执行《财政部关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》(财会〔2017〕30 号), 将原列报于“营业外收入”和“营业外支出”的非流动资产处置利得和损失和非货币性资产交换利得和损失变更为列报于“资产处置收益”。此项会计政策变更采用追溯调整法, 调减 2016 年度营业外收入 261, 546. 68 元, 营业外支出 159, 151. 83 元, 调增资产处置收益 102, 394. 85 元; 调减 2015 年度营业外收入 104, 408. 36 元, 营业外支出 178, 389. 36 元, 调增资产处置收益-73, 981. 00 元。

(2)重要会计估计变更

适用 不适用

47. 其他

适用 不适用

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	销售货物或提供应税劳务	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%
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	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 2017 年度暂按 15% 的税率计缴企业所得税。

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：	/	/	203,134.45	/	/	187,825.51
人民币	/	/	35,741.33	/	/	22,436.16
港元	13,487.10	0.8359	11,273.87	13,000.00	0.8945	11,628.50
新加坡元	31,025.20	4.8831	151,499.15	31,025.20	4.7995	148,905.45
台币	21,010.00	0.2199	4,620.10	22,510.00	0.2157	4,855.40
银行存款：	/	/	13,378,841,538.38	/	/	17,271,393,287.49
其中：自有资金	/	/	5,139,777,230.39	/	/	6,093,765,895.31
人民币	/	/	4,474,902,127.81	/	/	5,453,800,385.44
美元	17,972,705.89	6.5342	117,437,254.83	3,320,781.08	6.9370	23,036,258.35
港元	654,803,443.84	0.8359	547,350,198.71	689,564,522.07	0.8945	616,815,464.99
澳元	6,089.37	5.0928	31,011.94	6,085.34	5.0157	30,522.24
欧元	632.80	7.8023	4,937.30	636.77	7.3068	4,652.75
英镑	4,189.22	8.7792	36,778.00	4,177.66	8.5094	35,549.38
加拿大元	51.07	5.2009	265.61	237.33	5.1406	1,220.02
新加坡元	3,001.41	4.8831	14,656.19	276.97	4.7995	1,329.32
日元				679,848.00	0.0596	40,512.82
客户资金	/	/	8,239,064,307.99	/	/	11,177,627,392.18
人民币	/	/	8,125,359,955.05	/	/	11,034,223,724.81
美元	11,210,251.54	6.5342	73,250,025.61	13,998,011.92	6.9370	97,104,208.69
港元	48,348,954.56	0.8359	40,414,891.12	51,760,155.04	0.8945	46,299,458.68
日元	681,309.00	0.0579	39,436.21			
其他货币资金：	/	/	29,147,924.31	/	/	856,374,058.10
人民币	/	/	29,085,433.86	/	/	806,015,652.26
港元	74,758.29	0.8359	62,490.45	56,297,826.53	0.8945	50,358,405.84
合计	/	/	13,408,192,597.14	/	/	18,127,955,171.10

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	/	/	15,937,691.36	/	/	9,572,207.39
人民币	/	/	15,937,691.36	/	/	9,572,207.39
客户信用资金	/	/	997,895,263.05	/	/	1,338,023,177.21
人民币	/	/	997,895,263.05	/	/	1,338,023,177.21

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：	/	/	175,438,878.39	/	/	561,082,995.98
人民币	/	/	175,438,878.39	/	/	561,082,995.98
客户备付金：	/	/	1,823,243,063.88	/	/	2,576,488,781.45
人民币	/	/	1,800,301,140.08	/	/	2,547,551,494.69
美元	2,239,421.73	6.5342	14,632,829.47	3,239,496.77	6.9370	22,472,389.09
港元	9,940,297.08	0.8359	8,309,094.33	7,227,386.99	0.8945	6,464,897.67
客户信用备付金：	/	/	536,350,541.24	/	/	454,539,377.44
人民币	/	/	536,350,541.24	/	/	454,539,377.44
合计	/	/	2,535,032,483.51	/	/	3,592,111,154.87

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
个人客户	8,238,261,839.39	7,824,064,184.38
机构客户	542,263,204.73	233,480,856.71
减：减值准备	16,780,047.31	15,683,006.05
合计	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04

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	1,092,169,052.44	508,331,078.50
股票	24,089,463,436.32	20,987,933,671.34
合计	25,181,632,488.76	21,496,264,749.84

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	8,780,525,044.12	8,057,545,041.09
减：减值准备	16,780,047.31	15,683,006.05
合计	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04

(2) 按剩余到期日分析

单位：元 币种：人民币

期限	期末数
----	-----

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1-3 个月	2,496,028,560.71	28.43	4,211,116.19	0.17
3-6 个月	6,150,958,736.22	70.05	12,301,911.32	0.20
6 个月以上	133,537,747.19	1.52	267,019.80	0.20
合计	8,780,525,044.12	100.00	16,780,047.31	0.19

(续上表)

期限	期初数			
	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

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

期末余额						
项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	15,524,151,356.24		15,524,151,356.24	15,690,403,515.96		15,690,403,515.96
基金	3,682,206,089.16		3,682,206,089.16	3,702,884,852.56		3,702,884,852.56
股票	3,150,221,852.37		3,150,221,852.37	3,110,855,395.92		3,110,855,395.92
合计	22,356,579,297.77		22,356,579,297.77	22,504,143,764.44		22,504,143,764.44
期初余额						
项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	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

其他说明

变现在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 78、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	55,438,761.02	9,464,229.21
-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,601,328.60	1,836,229.21
-可供出售金融资产	53,837,432.42	
-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)				2,980,000,000.00		5,667,842.61				3,000,000,000.00		12,180,889.30
利率互换				2,980,000,000.00		5,667,842.61				3,000,000,000.00		12,180,889.30
货币衍生工具 (按类别列示)	1,500,000,000.00		62,692,500.00				1,500,000,000.00	5,233,962.80	167,477,025.71			
货币互换	1,500,000,000.00		62,692,500.00				1,500,000,000.00	5,233,962.80	167,477,025.71			
权益衍生工具 (按类别列示)				8,000,000.00		360,762.36				384,288.51	192,100.05	
股票期权				8,000,000.00		360,762.36				384,288.51	192,100.05	
信用衍生工具 (按类别列示)												
其他衍生工具 (按类别列示)				8,170,320.92		15,977.58				68,400,000.00	25,578.62	9,040.87
合计	1,500,000,000.00		62,692,500.00	2,996,170,320.92		6,044,582.55	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

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	2,170,984,242.00	1,760,323,442.35
债券	903,716,789.14	1,192,468,140.48
减：减值准备	9,404,021.14	7,382,077.17
买入返售金融资产账面价值	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66

(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	289,146,336.00	116,519,007.00
一个月至三个月内	185,345,206.00	76,800,006.00
三个月至一年内	1,240,562,700.00	722,940,429.35
一年以上	225,930,000.00	614,064,000.00
合计	1,940,984,242.00	1,530,323,442.35

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
非银行金融机构	229,891,900.14	1,010,965,865.47
其他	2,844,809,131.00	1,941,825,717.36
减：减值准备	9,404,021.14	7,382,077.17
合计	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66

(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	150,450,039.00	134,770,017.00
股票质押式回购	1,790,534,203.00	1,395,553,425.35
普通回购	1,133,716,789.14	1,422,468,140.48
合计	3,074,701,031.14	2,952,791,582.83

(3) 担保物情况

单位：元 币种：人民币

项目	收取担保物价值
约定购回	322,100,726.82
质押式回购	3,910,976,640.59
普通回购	1,142,691,725.74
合计	5,375,769,093.15

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	19,736,192.47	168,397,902.90
应收资产管理费	30,511,504.78	29,369,100.34
合计	50,247,697.25	197,767,003.24
减：减值准备		
应收款项账面价值	50,247,697.25	197,767,003.24

(2) 按账龄分析

□适用 √不适用

(3) 按评估方式列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提减值准备								
组合计提减值准备	50,247,697.25	100.00			197,767,003.24	100.00		
合计	50,247,697.25	100.00			197,767,003.24	100.00		

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	393,434,957.15	425,306,059.67
存放金融同业	2,005,812.43	1,981,394.62
融资融券	112,220,750.15	100,555,560.19
买入返售	4,527,762.92	9,996,484.40
其他	733,092.99	1,059,152.89
合计	512,922,375.64	538,898,651.77

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	138,509,616.11	182,612,422.79
信用保证金	18,954,890.43	1,115,057.40
履约保证金	85,880,101.35	238,075,890.28
期货保证金	58,686,776.57	198,197,325.60
股票期权保证金	5,243,306.31	5,158,061.90
合计	307,274,690.77	625,158,757.97

存出保证金的说明：

存出保证金——外币保证金

单位：元

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	6.5342	1,764,234.00	270,000.00	6.9370	1,872,990.00
港币	6,579,587.00	0.8359	5,499,876.77	4,868,720.64	0.8945	4,355,070.61
小计			7,264,110.77			6,228,060.61
信用保证金						
其中：美元				160,740.58	6.9370	1,115,057.40
小计						1,115,057.40
履约保证金						
其中：美元	13,143,169.99	6.5342	85,880,101.35	34,319,718.94	6.9370	238,075,890.29
小计			85,880,101.35			238,075,890.29
合计			93,144,212.12			245,419,008.30

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. 持有待售资产

 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	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	787,542,419.03	-3,189,980.25	3,041,650.00	781,310,788.78
可供出售权益工具	7,675,718,219.75	523,560,734.24	121,502,520.06	8,077,776,433.93
其中：按公允价值计量	7,012,569,505.25	523,560,734.24	88,418,082.43	7,447,712,157.06
按成本计量	663,148,714.50		33,084,437.63	630,064,276.87
合 计	8,463,260,638.78	520,370,753.99	124,544,170.06	8,859,087,222.71

(续上表)

项 目	期初数			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
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
其中：按公允价值计量	8,233,591,770.22	-75,656,479.70	71,684,676.85	8,086,250,613.67
按成本计量	770,054,853.94		13,847,481.11	756,207,372.83
合 计	11,730,449,152.10	-12,124,154.32	85,532,157.96	11,632,792,839.82

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。截至 2017 年 12 月 31 日，基于证金公司提供的投资账户公告，本公司对专户投资的成本为 210,000.00 万元，公允价值为 233,008.18 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	787,542,419.03	-3,189,980.25	3,041,650.00	781,310,788.78	812,419,042.70	-995,282.40		811,423,760.30
基金	2,228,750,671.80	234,400,112.04	107,890.65	2,463,042,893.19	3,606,854,238.44	-167,108,073.00		3,439,746,165.44
股票	3,055,292,790.83	260,552,782.47	82,894,591.78	3,232,950,981.52	3,175,769,853.72	32,252,668.42	71,684,676.85	3,136,337,845.29
证券公司理财产品	1,424,056,042.62	28,607,839.73	5,415,600.00	1,447,248,282.35	1,767,871,163.30	123,726,532.66		1,891,597,695.96
银行理财产品	304,470,000.00			304,470,000.00	966,000,000.00			966,000,000.00
其他	663,148,714.50		33,084,437.63	630,064,276.87	1,401,534,853.94		13,847,481.11	1,387,687,372.83
合计	8,463,260,638.78	520,370,753.99	124,544,170.06	8,859,087,222.71	11,730,449,152.10	-12,124,154.32	85,532,157.96	11,632,792,839.82

可供出售金融资产的说明

适用 不适用

(3) 截至报告期末以公允价值计量的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	7,012,569,505.25	787,542,419.03	7,800,111,924.28
公允价值	7,447,712,157.06	781,310,788.78	8,229,022,945.84
累计计入其他综合收益 的公允价值变动金额	382,120,593.92	-2,392,485.19	379,728,108.73
已计提减值金额	88,418,082.43	3,041,650.00	91,459,732.43

(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	可供出售债务工具	合计
期初已计提减值金额	85,532,157.96		85,532,157.96
本年计提	72,234,890.55	3,041,650.00	75,276,540.55
其中：从其他综合收益转入	72,234,890.55	3,041,650.00	75,276,540.55
本年减少	36,264,528.45		36,264,528.45
其中：期后公允价值回升转回			
期末已计提减值金额	121,502,520.06	3,041,650.00	124,544,170.06

(5) 其他

√适用□不适用

所有权或使用权收到限制的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 78、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	
其中（按类别列示）：			
其他			
持有至到期投资合计		99,441,565.00	
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	

持有至到期投资的说明：

□适用√不适用

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	1,856,824,343.53	208,252,876.04	1,648,571,467.49
合 计	1,856,824,343.53	208,252,876.04	1,648,571,467.49

(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	1,853,356,277.03	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

(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	
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备			其他
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
银华基金管理股份有限公司	1,621,964,192.55			192,997,852.10	-778,486.22	-84,724,587.28	80,887,503.66			1,648,571,467.49	208,252,876.04
小计	1,621,964,192.55			192,997,852.10	-778,486.22	-84,724,587.28	80,887,503.66			1,648,571,467.49	208,252,876.04
合计	1,621,964,192.55			192,997,852.10	-778,486.22	-84,724,587.28	80,887,503.66			1,648,571,467.49	208,252,876.04

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[2018]120号）。截至2017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	49,272,694.97	49,272,694.97
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	52,760,043.39	52,760,043.39
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	39,205,355.22	39,205,355.22
2. 期初账面价值	42,692,703.64	42,692,703.64

(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	4,848,976.21	相关产权正在办理
小计	4,848,976.21	

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	378,707,848.12	260,857,076.76	10,474,141.76	39,447,288.54	28,071,977.76	717,558,332.94
2. 本期增加金额	59,616,155.42	22,172,402.16	50,802.40	2,032,236.56	4,506,883.30	88,378,479.84
(1) 购置	59,616,155.42	22,172,402.16	50,802.40	2,032,236.56	4,506,883.30	88,378,479.84
3. 本期减少金额		23,777,407.67	1,486,842.29	3,638,694.07	3,820,863.18	32,723,807.21
(1) 处置或报废		23,777,407.67	1,486,842.29	3,638,694.07	3,820,863.18	32,723,807.21
4. 期末余额	438,324,003.54	259,252,071.25	9,038,101.87	37,840,831.03	28,757,997.88	773,213,005.57
二、累计折旧						
1. 期初余额	142,295,437.40	186,800,261.00	8,844,796.37	21,591,154.68	15,572,800.16	375,104,449.61

2. 本期增加金额	13,586,003.66	39,864,646.01	665,067.12	5,614,222.41	3,249,944.52	62,979,883.72
(1) 计提	13,586,003.66	39,864,646.01	665,067.12	5,614,222.41	3,249,944.52	62,979,883.72
3. 本期减少金额		17,980,838.71	1,443,536.27	2,795,104.01	3,185,676.06	25,405,155.05
(1) 处置或报废		17,980,838.71	1,443,536.27	2,795,104.01	3,185,676.06	25,405,155.05
4. 期末余额	155,881,441.06	208,684,068.30	8,066,327.22	24,410,273.08	15,637,068.62	412,679,178.28
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	275,317,395.86	50,568,002.95	971,774.65	13,430,557.95	13,120,929.26	353,408,660.67
2. 期初账面价值	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) 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	340,110,741.83		340,110,741.83	285,779,102.36		285,779,102.36
合计	340,110,741.83		340,110,741.83	285,779,102.36		285,779,102.36

(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	285,779,102.36	54,331,639.47	340,110,741.83	30.10	30.10	自有资金
合计	1,130,000,000.00	285,779,102.36	54,331,639.47	340,110,741.83	/	/	/

(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	146,571,787.52	8,455,624.87	1,400,000.00	315,006,332.23
2. 本期增加金额		33,248,569.67			33,248,569.67
(1) 购置		33,248,569.67			33,248,569.67
3. 本期减少金额					
4. 期末余额	158,578,919.84	179,820,357.19	8,455,624.87	1,400,000.00	348,254,901.90
二、累计摊销					
1. 期初余额	26,374,178.41	85,478,722.32	8,455,624.87		120,308,525.60
2. 本期增加金额	4,006,204.32	35,498,529.26			39,504,733.58
(1) 计提	4,006,204.32	35,498,529.26			39,504,733.58
3. 本期减少金额					
4. 期末余额	30,380,382.73	120,977,251.58	8,455,624.87		159,813,259.18
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	128,198,537.11	58,479,933.67		1,400,000.00	188,078,470.78
2. 期初账面价值	132,204,741.43	60,729,893.26		1,400,000.00	194,334,634.69

(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	其他	

西证国际证券股份有限公司	272,037,615.70				17,821,581.09	254,216,034.61
西南期货有限公司	40,620,597.75					40,620,597.75
合计	312,658,213.45				17,821,581.09	294,836,632.36

(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[2018]134号）。截至2017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，故本期不计提高誉减值准备。

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	287,038,631.98	58,992,847.70	242,053,558.46	49,991,496.56
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	133,359,134.36	33,339,783.59		
可抵扣亏损	13,708,165.69	2,735,873.90	16,438,885.30	4,109,721.33
计入其他综合收益的可供出售金融资产公允价值变动			52,531,613.93	13,574,527.02
应付职工薪酬	404,564,215.26	101,141,053.82	169,221,520.17	42,195,380.04
预计负债			64,180,032.69	16,045,008.17
结构化主体母公司承担亏损	255,614,301.09	63,710,740.08	160,030,578.39	35,404,579.09
其他	4,206,189.20	630,928.38	5,344,548.91	801,942.58

合计	1,098,490,637.58	260,551,227.47	709,800,737.85	162,122,654.79
----	------------------	----------------	----------------	----------------

(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
计入其他综合收益的可供出售金融资产公允价值变动	480,203,438.40	118,844,992.53		
合计	480,203,438.40	118,844,992.53	32,957,715.38	8,239,428.84

(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	363,191,043.39	327,840,956.19
长期待摊费用	87,760,363.93	87,629,916.85
应收股利	18,414,129.43	3,142,784.18
预付款项	45,596,030.59	114,421,311.49
发放贷款及垫款	145,443,462.87	135,351,665.33
预缴税费	59,598,460.56	64,835,014.29
其他	20,747,075.35	
合计	740,750,566.12	733,221,648.33

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				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	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	47.58	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	39,913,670.64	7.66	5,662,639.82	14.19	34,251,030.82
无收款风险组合	127,049,208.02	24.39			127,049,208.02
单项金额不重大但单项计提坏账准备	106,061,279.39	20.37	43,210,724.84	40.74	62,850,554.55
合计	520,846,658.05	100.00	157,655,614.66	30.27	363,191,043.39

(续上表)

种类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	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
单项金额不重大但单项计提坏账准备	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

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	预期回款期限长
应收投资款	120,000,000.00	96,000,000.00	80.00	款项回收非常困难
小计	247,822,500.00	108,782,250.00		

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	32,074,030.28	80.36	1,603,785.82	5.00
1-2 年	1,578,335.92	3.95	157,833.59	10.00
2-3 年	2,014,783.29	5.05	604,434.99	30.00
3-4 年	1,516,690.01	3.80	758,345.01	50.00
4-5 年	957,953.64	2.40	766,362.91	80.00
5 年以上	1,771,877.50	4.44	1,771,877.50	100.00
小计	39,913,670.64	100.00	5,662,639.82	14.19

(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 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

2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 3,640,793.71 元, 本期转回坏账准备 32,721,675.19 元。

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	36,497,434.54	67,672,302.96
拆借款	103,477,171.60	117,498,892.31
应收暂付款	106,025,874.79	62,910,159.09
投资款	120,000,000.00	120,000,000.00
股权质押回购款	130,406,578.98	127,822,500.00
其他	24,439,598.14	18,673,597.97
其他应收款项合计	520,846,658.05	514,577,452.33
减: 其他应收款项减值准备	157,655,614.66	186,736,496.14
合计	363,191,043.39	327,840,956.19

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	占其他应收款账面余额的比例(%)	坏账准备
蔡开坚	股权质押回购款	127,822,500.00	2-3 年	24.54	12,782,250.00
河南富田畜牧发展有限公司	投资款	120,000,000.00	5 年以上	23.04	96,000,000.00
摩根士丹利	应收暂付款	44,591,691.76	1 年以内	8.56	
短欠融资客户#80809619	拆借款	24,158,882.60	1-2 年	4.64	11,064,084.63
短欠融资客户#80811500	拆借款	22,910,592.59	1-2 年	4.40	4,384,542.56
小计		339,483,666.95		65.18	124,230,877.19

(2) 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	51,744,195.43	31,379,557.14	14,519,572.87	68,604,179.70
网络工程	6,317,730.95	2,707,098.43	2,257,761.27	6,767,068.11
其他	29,567,990.47	15,405,418.80	32,584,293.15	12,389,116.12
合计	87,629,916.85	49,492,074.37	49,361,627.29	87,760,363.93

(3) 应收股利

单位: 元 币种: 人民币

项目	期初数	期末数	未收回的原因	相关款项是否发生减值
账龄 1 年以内				
其中: 基金、股票红利	3,142,784.18	18,414,129.43	宣告尚未发放	否
合计	3,142,784.18	18,414,129.43		

(4) 预付款项

1) 账龄分析

单位: 元 币种: 人民币

账龄	期末数			账面价值
	账面余额	比例(%)	坏账准备	
1 年以内	33,221,640.60	72.86		33,221,640.60

1-2 年	9,134,681.69	20.03		9,134,681.69
2-3 年	1,458,864.72	3.20		1,458,864.72
3 年以上	1,780,843.58	3.91		1,780,843.58
合计	45,596,030.59	100.00		45,596,030.59

(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	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

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 (%)
恒生电子股份有限公司	业务平台采购款	4,982,524.80	10.93
重庆龙湖嘉凯地产开发有限公司	购房款	3,794,400.00	8.32
北京信诚华远投资顾问有限公司	预付租金	1,917,964.00	4.21
Epoch Market	采购款	1,670,128.20	3.66
四川福盛建设工程有限公司	工程款	1,004,747.89	2.20
小计		13,369,764.89	29.32

(5) 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	161,866,078.04	151,546,765.33
发放贷款及垫款合计	161,866,078.04	151,546,765.33
减：减值准备	16,422,615.17	16,195,100.00
合计	145,443,462.87	135,351,665.33

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	转销	
买入返售金融资产减值准备	7,382,077.17	2,021,943.97			9,404,021.14
坏账准备	186,736,496.14	3,640,793.71	32,721,675.19		157,655,614.66
可供出售金融资产减值准备	85,532,157.96	75,276,540.55		36,264,528.45	124,544,170.06
长期股权投资减值准备	231,392,084.48			23,139,208.44	208,252,876.04
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	16,195,100.00	227,515.17			16,422,615.17
融资融券减值准备	15,701,812.74	1,097,041.26		18,806.69	16,780,047.31
合计	587,517,289.48	82,263,834.66	32,721,675.19	59,422,543.58	577,636,905.37

注：本期长期股权投资减值准备转销 23,139,208.44 元，系本公司联营企业银华基金管理股份有限公司本期实施增资扩股暨员工持股方案，增加注册资本 2,220 万元，本公司对其持股比例由 49.00% 下降至 44.10%，持股比例下降部分视同对长期股权投资的处置，故转销部分长期股权投资减值准备。

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	发行金额	票面利率
西南证券收益凭证聚金[2017012]	200,000,000.00	2017/10/17	3 个月	200,000,000.00	4.00%
西南证券保本收益凭证聚金[2017015]	200,000,000.00	2017/12/1	3 个月	200,000,000.00	4.00%
西南证券沪深 300 指数型浮动收益凭证聚鑫[2017001A]	150,000.00	2017/12/6	28 天	150,000.00	
西南证券沪深 300 指数型浮动收益凭证聚鑫[2017001B]	1,150,000.00	2017/12/6	28 天	1,150,000.00	
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%
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	7,769,700,000.00			7,769,700,000.00	

(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[2017012]		200,000,000.00		200,000,000.00
西南证券保本收益凭证聚金[2017015]		200,000,000.00		200,000,000.00
西南证券沪深 300 指数型浮动收益凭证聚鑫[2017001A]		150,000.00		150,000.00
西南证券沪深 300 指数型浮动收益凭证聚鑫[2017001B]		1,150,000.00		1,150,000.00
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	
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	7,368,400,000.00	401,300,000.00	7,368,400,000.00	401,300,000.00

30. 拆入资金
 适用 不适用

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

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
第三方在结构化主体中享有的权益		4,491,272,924.10	4,491,272,924.10		5,482,862,745.17	5,482,862,745.17
股票	866,650.00		866,650.00	7,628,000.00		7,628,000.00
合计	866,650.00	4,491,272,924.10	4,492,139,574.10	7,628,000.00	5,482,862,745.17	5,490,490,745.17

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	7,068,365,760.00	6,780,845,721.37
其他	2,750,000,000.00	2,900,000,000.00
合计	9,818,365,760.00	9,680,845,721.37

(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	78,068,000.00	2.00-3.00	38,934,000.00	2.00-3.00
一个月至三个月内	865,000.00		100,000.00	
三个月至一年内				
一年以上				
合计	78,933,000.00		39,034,000.00	

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	78,933,000.00	39,034,000.00
其他卖出回购金融资产款	9,739,432,760.00	9,641,811,721.37
合计	9,818,365,760.00	9,680,845,721.37

(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	4,914,255,000.00	573,414,056.16
非银行金融机构	4,904,110,760.00	9,107,431,665.21
合计	9,818,365,760.00	9,680,845,721.37

(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 10,186,731,690.19 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	8,796,023,120.99	12,015,694,592.94
其中：个人	7,492,261,878.30	10,202,676,575.15
机构	1,303,761,242.69	1,813,018,017.79
信用业务	1,091,649,362.99	1,276,432,930.70
其中：个人	985,622,681.30	1,223,029,534.17
机构	106,026,681.69	53,403,396.53
合计	9,887,672,483.98	13,292,127,523.64

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	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	51,317,269.46	0.8359	42,896,105.54	51,688,329.13	0.8945	46,235,210.41
美元	12,755,101.08	6.5342	83,344,381.48	16,534,738.99	6.9370	114,701,484.37
小计			126,240,487.02			160,936,694.78

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	43,879,425.63	137,729,419.02
应付手续费及佣金	10,197,298.58	153,092.92
应付托管费	1,173,765.39	1,672,565.17
其他	101,305.42	60,183.25
合计	55,351,795.02	139,615,260.36

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	971,780,417.04	1,352,363,318.71	1,457,296,648.06	866,847,087.69
二、离职后福利-设定提存计划	3,068,959.89	78,279,354.42	78,680,489.56	2,667,824.75
三、辞退福利	1,006,814.21	14,431.95	606,942.83	414,303.33
四、离职后福利—设定受益计划	24,325,277.23	-4,148,345.03	641,744.53	19,535,187.67
合计	1,000,181,468.37	1,426,508,760.05	1,537,225,824.98	889,464,403.44

(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	957,355,545.30	1,220,679,908.42	1,337,236,542.65	840,798,911.07
二、职工福利费	15,915.69	20,689,196.04	20,687,811.73	17,300.00
三、社会保险费	1,610,377.83	42,222,235.83	42,157,240.46	1,675,373.20
其中: 医疗保险费	323,484.75	38,637,822.94	38,547,888.24	413,419.45
工伤保险费	33,257.84	1,400,410.09	1,402,848.34	30,819.59
生育保险费	1,253,635.24	2,184,002.80	2,206,503.88	1,231,134.16
四、住房公积金	140,144.09	45,394,687.45	45,185,685.08	349,146.46
五、工会经费和职工教育经费	12,658,434.13	23,377,290.97	12,029,368.14	24,006,356.96
合计	971,780,417.04	1,352,363,318.71	1,457,296,648.06	866,847,087.69

(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	1,741,248.72	65,907,029.00	65,894,486.40	1,753,791.32
2、失业保险费	456,496.76	2,610,556.37	2,679,954.56	387,098.57
3、企业年金缴费	871,214.41	9,761,769.05	10,106,048.60	526,934.86
合计	3,068,959.89	78,279,354.42	78,680,489.56	2,667,824.75

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	24,325,277.23
计入当期综合收益的设定受益成本	-4,148,345.03
①利息净额	880,648.01
②重新计量变动	-5,028,993.04
其他变动	-641,744.53
①已支付的福利	-641,744.53
期末余额	19,535,187.67

(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	24,325,277.23
计入当期损益的设定受益成本	880,648.01
计入其他综合收益的设定受益成本	-5,028,993.04
其他变动	-641,744.53
期末余额	19,535,187.67

(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4.32%，社平工资增长率区分重庆地区和深圳地区情况，设置为9.00%—4.00%，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	2,609,467.62	12,140,423.94
企业所得税	15,917,285.87	13,009,265.59
个人所得税	39,464,880.54	114,387,883.14
城市维护建设税	200,455.42	1,081,342.43
教育费附加	98,752.84	473,480.25
地方教育附加	54,857.87	290,610.23
投资者保护基金	60,980,982.66	20,500,038.79
其他	955,009.98	1,825,340.14
合计	120,281,692.80	163,708,384.51

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
应付短期融资款	39,452,589.02	74,930,136.99
应付债券	229,010,951.32	226,954,027.80
卖出回购	17,069,811.59	39,271,647.69
其他	150,144.92	
合计	285,683,496.85	341,155,812.48

41. 持有待售负债

□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

项 目	期末数	期初数
次级债	7,000,000,000.00	6,000,000,000.00
公司债	7,483,849,842.62	7,447,553,351.21
固定收益凭证	2,470,000,000.00	
合 计	16,953,849,842.62	13,447,553,351.21

(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	3,991,930,348.98	3,977,911,249.64
14 西南 02 债	2,000,000,000.00	2015/7/23	5 年	2,000,000,000.00	3.67	1,989,345,917.12	1,985,525,917.83
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	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	3,000,000,000.00
港交所公司债	1,500,000,000.00	2015/5/29	3 年	1,476,210,799.35	3.89	1,502,573,576.52	1,484,116,183.74
17 西南 C1	1,000,000,000.00	2017/12/21	3 年	1,000,000,000.00	6.27	1,000,000,000.00	
西南证券保本收益凭证聚金[2017007]	250,000,000.00	2017/6/28	2 年	250,000,000.00	5.40	250,000,000.00	
西南证券保本收益凭证聚金[2017008]	750,000,000.00	2017/7/11	2 年	750,000,000.00	5.27	750,000,000.00	
西南证券本金保障型收益凭证[2017011]	400,000,000.00	2017/9/21	2 年	400,000,000.00	5.50	400,000,000.00	
西南证券本金保障型收益凭证[2017013]	370,000,000.00	2017/10/20	2 年	370,000,000.00	5.45	370,000,000.00	
西南证券保本收益凭证聚金[2017014]	700,000,000.00	2017/10/30	2 年	700,000,000.00	5.50	700,000,000.00	
合计	16,970,000,000.00			16,946,210,799.35		16,953,849,842.62	13,447,553,351.21

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		/

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	36,245,347.61	32,694,637.61
其他应付款	506,396,987.19	106,378,556.68
代理兑付债券款	511,638.50	511,638.50
预收款项	20,567.52	6,669,507.52
期货风险准备金	10,056,062.55	8,348,056.42
递延收益	710,312.76	1,140,992.76
合计	553,940,916.13	155,743,389.49

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	36,245,347.61	32,694,637.61	股利领取相关事宜正在办理中
合计	36,245,347.61	32,694,637.61	

(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	33,973,664.49	54,566,237.33
应付暂收款	39,299,794.13	14,327,799.63
信息系统及设备尾款	3,463,168.10	4,973,072.53
债券承销募集资金	400,000,000.00	
其他	29,660,360.47	32,511,447.19
合计	506,396,987.19	106,378,556.68

(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	20,567.52	19,507.52
合计	20,567.52	6,669,507.52

(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	710,312.76	1,140,992.76
合计	710,312.76	1,140,992.76

注：本期计入当期损益政府补助情况详见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 81、政府补助”。

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		84,724,587.28	312,030,356.68
合计	7,852,067,958.06		84,724,587.28	7,767,343,370.78

注：本公司联营企业银华基金管理股份有限公司本期实施增资扩股暨员工持股方案，由于银华基金管理股份有限公司增资事项导致的本公司对其长期股权投资账面价值变动计入资本公积。

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	-7,622,106.64	5,028,993.04			5,028,993.04		-2,593,113.60
其中：重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动	-7,622,106.64	5,028,993.04			5,028,993.04		-2,593,113.60
以后将重分类进损益的其他综合收益	50,156,801.06	779,204,083.64	213,480,905.98	203,630,556.27	357,962,101.02	4,130,520.37	408,118,902.08
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	1,237,472.05	-778,486.22			-778,486.22		458,985.83
可供出售金融资产公允价值变动损益	-9,429,085.65	810,247,664.88	213,480,905.98	203,630,556.27	389,157,194.38	3,979,008.25	379,728,108.73

外币财务报表折算差额	64,231,479.29	-30,265,095.02			-30,416,607.14	151,512.12	33,814,872.15
其他	-5,883,064.63						-5,883,064.63
其他综合收益合计	42,534,694.42	784,233,076.68	213,480,905.98	203,630,556.27	362,991,094.06	4,130,520.37	405,525,788.48

(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	810,247,664.88	-43,298,688.12
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	203,630,556.27	6,120,341.63
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	213,480,905.98	130,680,833.47
小计	393,136,202.63	-180,099,863.22
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	-778,486.22	585,467.50
小计	-778,486.22	585,467.50
3. 重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动	5,028,993.04	-1,942,904.64
小计	5,028,993.04	-1,942,904.64
4. 外币财务报表折算差额	-30,265,095.02	43,127,928.25
小计	-30,265,095.02	43,127,928.25
5. 其他		-54,653,898.69
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响		-13,663,474.67
小计		-40,990,424.02
合计	367,121,614.43	-179,319,796.13

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	926,129,306.65	83,715,953.18		1,009,845,259.83
合计	926,129,306.65	83,715,953.18		1,009,845,259.83

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	887,639,312.45	83,715,953.18			971,355,265.63
交易风险准备	887,639,312.45	83,715,953.18			971,355,265.63
合计	1,775,278,624.90	167,431,906.36			1,942,710,531.26

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	2,760,152,434.68	2,873,145,282.45
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	2,760,152,434.68	2,873,145,282.45
加：本期归属于母公司所有者的净利润	668,800,161.74	917,572,729.00
减：提取法定盈余公积	83,715,953.18	98,900,463.55
提取一般风险准备	167,431,906.36	197,800,927.10
应付普通股股利	564,510,912.40	733,864,186.12
期末未分配利润	2,613,293,824.48	2,760,152,434.68

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	1,820,466,180.04	2,959,427,458.43
证券经纪业务	886,636,366.32	1,152,740,448.51
其中：代理买卖证券业务	747,894,560.97	1,005,350,082.67
交易单元席位租赁	122,300,998.53	124,200,773.14
代销金融产品业务	16,440,806.82	23,189,592.70
期货经纪业务	39,379,126.52	24,426,746.44
投资银行业务	708,403,816.53	1,567,244,387.33
其中：证券承销业务	393,314,466.62	964,176,079.49
证券保荐业务	40,325,685.01	70,664,338.74
财务顾问业务	274,763,664.90	532,403,969.10
资产管理业务	103,990,780.34	117,370,202.44
基金管理业务	23,635,565.78	46,050,528.83
投资咨询业务	10,074,932.13	14,037,489.23
其他	48,345,592.42	37,557,655.65
手续费及佣金支出	395,641,698.00	546,229,025.05
证券经纪业务	249,921,650.46	324,857,670.05
其中：代理买卖证券业务	249,834,200.37	324,857,670.05
代销金融产品业务	87,450.09	
期货经纪业务	13,207,140.83	8,226,905.71
投资银行业务	82,220,081.63	199,504,291.68
其中：证券承销业务	52,787,595.06	134,689,520.75
证券保荐业务	6,899,045.78	9,544,125.54
财务顾问业务	22,533,440.79	55,270,645.39
资产管理业务	20,066,987.41	4,334,746.64
基金管理业务	8,522,518.74	
投资咨询业务	8,545,576.72	8,413,376.50
其他	13,157,742.21	892,034.47
手续费及佣金净收入	1,424,824,482.04	2,413,198,433.38
其中：财务顾问业务净收入	252,230,224.11	477,133,323.71
— 并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	79,600,293.26	177,264,162.94
— 并购重组财务顾问业务净收入—其他	102,010,162.96	202,575,018.53
— 其他财务顾问业务净收入	70,619,767.89	97,294,142.24

(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	804,829,381.10	6,053,002.61	4,251,477,546.90	18,178,867.99
银行理财产品	633,280,000.00	4,762,805.11	331,421,000.00	1,351,986.10
信托	482,700,000.00	3,630,315.22	72,300,000.00	294,937.84
其他	265,220,468.95	1,994,683.88	824,590,000.00	3,363,800.77
合计	2,186,029,850.05	16,440,806.82	5,479,788,546.90	23,189,592.70

(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	69.00	109.00	5.00
期末客户数量	5,517.00	109.00	33.00
其中：个人客户	5,409.00	97.00	
机构客户	108.00	12.00	33.00
期初受托资金	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
期末受托资金	25,801,742,291.27	63,711,127,497.27	2,750,828,550.00
其中：自有资金投入	1,461,712,738.83		12,000,000.00
个人客户	5,911,413,964.62	694,221,200.00	
机构客户	18,428,615,587.82	63,016,906,297.27	2,738,828,550.00
期末主要受托资产初始成本	26,235,380,589.96	65,005,460,136.14	2,750,828,550.00
其中：股票	885,660,459.90	5,743,420,966.93	
国债			
其他债券	22,349,281,159.66	11,047,866,956.08	
基金	602,339,413.77	4,889,900,000.00	
其他	2,398,099,556.63	43,324,272,213.13	2,750,828,550.00
当期资产管理业务净收入	17,690,221.77	56,137,545.38	10,096,025.78

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	1,342,426,171.27	5,266,444,443.46	受托管理资金	92,893,768,169.53	111,647,175,898.88
客户结算备付金	167,597,125.52	338,002,678.72	应付款项	137,454,284.97	188,987,183.01
存出与托管客户资金	24,737,480.68	59,175,138.65	卖出回购	2,755,652,330.75	3,085,343,095.00
应收款项	1,185,375,912.96	1,976,312,995.92			
受托投资	93,066,738,094.82	107,281,570,920.14			
其中：投资成本	93,991,669,276.10	107,645,548,227.24			
已实现未结算损益	-924,931,181.28	-363,977,307.10			

合计	95,786,874,785.25	114,921,506,176.89	合计	95,786,874,785.25	114,921,506,176.89
----	-------------------	--------------------	----	-------------------	--------------------

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	1,287,822,089.80	1,385,699,484.13
存放金融同业利息收入	482,036,923.14	519,860,265.07
其中：自有资金存款利息收入	226,181,124.41	201,854,510.94
客户资金存款利息收入	255,855,798.73	318,005,754.13
融资融券利息收入	621,579,097.91	642,002,983.69
买入返售金融资产利息收入	156,003,624.02	163,719,984.02
其中：约定购回利息收入	9,381,924.81	14,377,065.90
股权质押回购利息收入	89,158,504.22	87,039,387.33
其他	28,202,444.73	60,116,251.35
利息支出	1,505,332,762.33	1,351,329,292.61
客户资金存款利息支出	42,747,987.30	57,490,610.11
卖出回购金融资产利息支出	434,596,336.25	412,190,950.06
其中：报价回购利息支出	1,385,441.59	1,791,041.06
短期借款利息支出	153,330,320.38	263,776,027.32
拆入资金利息支出	6,420,717.04	14,398,502.40
其中：转融通利息支出	99,578.15	3,361,750.00
应付债券利息支出	407,355,788.58	363,967,204.57
次级债券利息支出	215,494,524.07	215,656,061.73
其他	245,387,088.71	23,849,936.42
利息净收入	-217,510,672.53	34,370,191.52

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	192,997,852.10	151,874,016.03
金融工具投资收益	1,806,860,129.06	1,218,712,671.20
其中：持有期间取得的收益	1,226,587,874.51	1,133,917,122.11
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	966,779,508.67	708,783,355.53
—持有至到期投资	8,281,206.38	39,197,989.56
—可供出售金融资产	256,627,323.38	279,690,599.95
—衍生金融工具	-5,100,163.92	106,245,177.07
处置金融工具取得的收益	580,272,254.55	84,795,549.09
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-48,722,833.02	59,007,917.66
—持有至到期投资	-1,190,705.28	
—可供出售金融资产	667,655,801.46	111,134,276.48
—衍生金融工具	-37,470,008.61	-85,346,645.05
合计	1,999,857,981.16	1,370,586,687.23

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	192,997,852.10	151,874,016.03	被投资单位业绩上升
小计	192,997,852.10	151,874,016.03	

63. 资产处置收益

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置	-102,751.22	102,394.85	-102,751.22
合 计	-102,751.22	102,394.85	-102,751.22

64. 公允价值变动收益 /（损失）

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项 目	本期发生额	上期发生额
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-159,691,435.12	-219,084,860.65
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	2,434,299.46	-56,029,641.37
衍生金融工具	80,120,707.60	-10,107,684.37
合 计	-77,136,428.06	-285,222,186.39

65. 其他收益

单位：元 币种：人民币

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
递延收益-政府补助	430,680.00		430,680.00
专项人才奖励	753,286.00		753,286.00
财政奖励	3,758,430.26		3,758,430.26
产业扶持资金	12,760,000.00		12,760,000.00
合 计	17,702,396.26		17,702,396.26

注：本期计入其他收益的政府补助详见本年度报告“第十一节、财务报告 七、合并财务报表项目注释 81、政府补助”

66. 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	9,453,061.46	5,382,629.37
代扣代缴个人所得税手续费	11,447,780.78	7,460,766.77
其他	3,276,450.88	2,571,121.25
合 计	24,177,293.12	15,414,517.39

67. 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
城市维护建设税	10,084,628.85	17,889,163.12
教育费附加	4,219,725.42	7,365,164.75
地方教育费附加	2,903,989.92	4,998,262.72
房产税	4,207,121.06	1,538,077.56
其他	5,273,580.65	605,894.29
合计	26,689,045.90	122,657,115.78

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月及2017年度房产税、土地使用税和印花税的发生额列报于“税金及附加”项目，2016年5月之前的发生额仍列报于“业务及管理费”项目。

68. 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	1,431,537,753.09	1,719,736,035.35
租赁费	123,525,380.63	99,368,419.57
咨询费	25,445,340.01	47,119,125.15
折旧费	62,979,883.72	61,139,278.12
业务招待费	41,012,804.15	52,681,831.94
电子设备运转费	52,039,407.40	41,537,418.71
差旅费	36,773,340.99	38,496,209.43
邮电费	39,489,282.65	40,390,328.45
公杂费	10,731,576.65	19,889,115.91
证券投资保护基金	86,926,689.65	27,837,188.67
其他	171,665,209.57	184,423,757.97
合计	2,082,126,668.51	2,332,618,709.27

69. 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	-24,480,391.37	-57,803,716.34
二、可供出售金融资产减值损失	75,276,540.55	71,684,676.85
三、融资融券减值损失	1,097,041.26	-3,262,055.01
四、其他	2,249,459.14	2,753,841.95
合计	54,142,649.58	13,372,747.45

70. 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	3,487,348.42
代扣代缴个税手续费奖励支出	8,111,760.68	1,310,702.63
其他		617,587.85
合计	11,599,109.10	5,415,638.90

71. 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
政府补助		36,642,416.78	
违约金及罚款收入	28,301.89		28,301.89
其他	964,533.32	3,465,173.44	964,533.32
合计	992,835.21	40,107,590.22	992,835.21

计入当期损益的政府补助

 适用 不适用

其他说明：

 适用 不适用

72. 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
对外捐赠	6,548,578.60	4,567,288.07	6,548,578.60
非常损失	230.63	186.27	230.63
罚款支出	36,000,000.00	2,466,304.17	36,000,000.00
赔偿支出	1,897,224.71	64,180,032.69	1,897,224.71
其他	116,843.84	60,805.29	116,843.84
合计	44,562,877.78	71,274,616.49	44,562,877.78

73. 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	271,997,713.15	210,178,793.30
递延所得税费用	-120,242,528.54	3,650,607.40
合计	151,755,184.61	213,829,400.70

(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	842,637,246.44
按法定/适用税率计算的所得税费用	210,659,311.61
子公司适用不同税率的影响	-20,910,854.23
调整以前期间所得税的影响	-3,364,379.49
非应税收入的影响	-70,688,704.88
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	15,163,713.10
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	20,896,098.50
所得税费用	151,755,184.61

其他说明：

 适用 不适用

74. 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”。

75. 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	317,884,067.20	373,158,718.94
收回定期存款及保证金等		200,000,000.00
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	17,702,396.26	36,642,416.78
清算款	400,018,430.51	
其他	30,621,769.80	18,879,690.83
合计	766,226,663.77	814,304,852.92

(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
付现的费用	585,335,042.87	637,469,736.64
衍生金融工具亏损	42,570,172.53	
其他	33,911,069.59	60,205,783.14
合计	661,816,284.99	697,675,519.78

(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	4,248,859.68	3,040,896.12
合计	4,248,859.68	3,040,896.12

(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
合计		1,742,919,848.94

(6) 支付的其他与筹资活动有关的现金
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付结构化主体中第三方的现金	1,061,857,205.60	
合计	1,061,857,205.60	

76. 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
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	690,882,061.83	912,701,377.38
加：资产减值准备	54,142,649.58	13,372,747.45
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	66,467,232.14	64,626,626.54
无形资产摊销	39,504,733.58	26,610,253.25
长期待摊费用摊销	49,361,627.29	37,651,301.78
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）	102,751.22	-102,394.85
公允价值变动损失（收益以“－”号填列）	77,136,428.06	285,222,186.39
利息支出	776,180,633.03	843,399,293.62
汇兑损失（收益以“－”号填列）	111,047,538.67	-83,311,977.77
投资损失（收益以“－”号填列）	-1,124,371,478.04	-581,896,882.01
递延所得税资产减少（增加以“－”号填列）	-112,003,099.70	74,613,767.14
递延所得税负债增加（减少以“－”号填列）	-8,239,428.84	-70,964,860.22
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）	-918,424,945.68	-5,376,695,729.24
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-577,009,433.83	1,804,669,526.19
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	-3,286,014,335.34	-8,565,590,778.20
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-4,161,237,066.03	-10,615,695,542.55

2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	13,408,192,597.14	18,127,955,171.10
减: 现金的期初余额	18,127,955,171.10	22,005,059,526.75
加: 现金等价物的期末余额	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87
减: 现金等价物的期初余额	3,592,111,154.87	4,373,744,276.33
现金及现金等价物净增加额	-5,776,841,245.32	-4,658,737,477.11

(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	13,408,192,597.14	18,127,955,171.10
其中: 库存现金	203,134.45	187,825.51
可随时用于支付的银行存款	13,378,841,538.38	17,271,393,287.49
可随时用于支付的其他货币资金	29,147,924.31	856,374,058.10
二、现金等价物	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87
其中: 结算备付金	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87
三、期末现金及现金等价物余额	15,943,225,080.65	21,720,066,325.97

其他说明:

 适用 不适用

77. 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

78. 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	7,202,817,136.84	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	120,771,261.92	停牌股票
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,601,328.60	融出证券
可供出售金融资产	53,837,432.42	融出证券

可供出售金融资产	45,423,277.98	停牌股票
可供出售金融资产	354,985,014.39	限售股
融出资金	2,983,914,553.35	用作卖出回购金融资产抵押物
合计	10,763,350,005.50	

79. 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			13,408,192,597.14
其中: 美元	29,182,957.43	6.5342	190,687,280.44
欧元	632.80	7.8023	4,937.30
港币	703,240,643.79	0.8359	587,838,854.15
澳元	6,089.37	5.0928	31,011.94
英镑	4,189.22	8.7792	36,778.00
加拿大元	51.07	5.2009	265.61
日元	681,309.00	0.0579	39,436.21
新加坡元	34,026.61	4.8831	166,155.34
台币	21,010.00	0.2199	4,620.10
人民币			12,629,383,258.05
其他应收款			520,846,658.05
其中: 港币	112,426,332.81	0.8359	93,977,171.60
人民币			426,869,486.45
结算备付金			2,535,032,483.51
其中: 美元	2,239,421.73	6.5342	14,632,829.47
港币	9,940,297.08	0.8359	8,309,094.33
人民币			2,512,090,559.71

(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。

80. 套期

适用 不适用

81. 政府补助

(1) 政府补助基本情况

适用 不适用

(2) 政府补助退回情况

适用 不适用

其他说明

(1) 明细情况

①与收益相关，且用于补偿公司以后期间的相关成本费用或损失的政府补助

单位：元 币种：人民币

项 目	期初递延收益	本期新增补助	本期结转	期末递延收益	本期结转列报项目
政府补助	1,140,992.76		430,680.00	710,312.76	其他收益
小 计	1,140,992.76		430,680.00	710,312.76	

②与收益相关，且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

单位：元 币种：人民币

项 目	金额	列报项目	说明
专项人才奖励	753,286.00	其他收益	与收益相关
财政奖励	3,758,430.26	其他收益	与收益相关
产业扶持基金	12,760,000.00	其他收益	与收益相关
小 计	17,271,716.26		

(2) 本期计入当期损益的政府补助金额为 17,702,396.26 元。

82. 其他

 适用 不适用

八、母公司财务报表项目注释

1. 应收账款

(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	29,834,463.84	100.00		
合 计	29,834,463.84	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 (%)
无收款风险组合	41,158,892.65	100.00		
合 计	41,158,892.65	100.00		

(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	29,834,463.84	41,158,892.65
应收款项合计	29,834,463.84	41,158,892.65
减：应收款项减值准备		
合 计	29,834,463.84	41,158,892.65

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	1,856,824,343.53	208,252,876.04	1,648,571,467.49
对子公司投资	4,030,764,254.80	29,597,900.00	4,001,166,354.80
合 计	5,887,588,598.33	237,850,776.04	5,649,737,822.29

(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	1,853,356,277.03	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

(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	800,000,000.00			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	1,800,000,000.00			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	4,030,764,254.80			4,030,764,254.80		29,597,900.00

(3) 对联营、合营企业投资

对联营、合营企业的投资详见本年度报告“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”。

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	171,459,932.93	146,855,065.48
应收股利	34,140.46	713,431.27
长期待摊费用	80,146,834.32	85,071,120.16
预付款项	33,952,125.26	103,866,796.76
预缴税费	28,849,443.13	26,102,851.76
小 计	314,442,476.10	362,609,265.43

(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				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	127,822,500.00	67.29	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	38,456,420.53	20.24	5,466,794.04	14.22	32,989,626.49
无收款风险组合	21,104,385.36	11.11			21,104,385.36
单项金额不重大并单项计提坏账准备	2,584,078.98	1.36	258,407.90	10.00	2,325,671.08
合 计	189,967,384.87	100.00	18,507,451.94	9.74	171,459,932.93

(续上表)

种 类	期初数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
单项金额重大并单项计提坏账准备	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

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	31,963,506.17	83.11	1,598,175.31	5.00
1-2 年	404,077.60	1.05	40,407.76	10.00
2-3 年	1,986,985.77	5.17	596,095.73	30.00
3-4 年	1,356,290.01	3.53	678,145.00	50.00
4-5 年	957,953.64	2.49	766,362.90	80.00
5 年以上	1,787,607.34	4.65	1,787,607.34	100.00
小 计	38,456,420.53	100.00	5,466,794.04	14.22

(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	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

2) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备 1,474,148.40 元。

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	19,194,051.62	18,947,430.02
应收暂付款	40,206,224.90	15,167,575.13
股权质押回购款	130,406,578.98	127,822,500.00
其他	160,529.37	1,950,863.87
其他应收款项合计	189,967,384.87	163,888,369.02
减：其他应收款项减值准备	18,507,451.94	17,033,303.54
合 计	171,459,932.93	146,855,065.48

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	占其他应收款账面余额的比例 (%)	坏账准备
蔡开坚	逾期股票质押回购款	127,822,500.00	2-3 年	67.29	12,782,250.00
重庆市劳动保障监察总队	押金	4,400,000.00	3-4 年	2.32	
吴小文	逾期股票质押回购款	2,099,384.68	1 年以内	1.11	209,938.47
信诚华远	押金	1,917,964.00	1-2 年	1.01	
中保大厦有限公司	押金	1,343,868.16	3-4 年	0.71	
小 计		137,583,716.84		72.44	

(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	34,140.46	713,431.27		
其中：				
基金、股票红利	34,140.46	713,431.27	宣告但尚未发放	否
合 计	34,140.46	713,431.27		

(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	49,351,565.69	22,578,543.92	10,897,926.52	61,032,183.09
网络工程	6,249,953.95	2,707,098.43	2,231,517.27	6,725,535.11
其他	29,469,600.52	15,405,418.75	32,485,903.15	12,389,116.12
合计	85,071,120.16	40,691,061.10	45,615,346.94	80,146,834.32

(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	21,682,549.99	63.86		21,682,549.99
1-2 年	9,119,831.89	26.86		9,119,831.89
2-3 年	1,421,835.82	4.19		1,421,835.82
3-4 年	1,727,907.56	5.09		1,727,907.56
合计	33,952,125.26	100.00		33,952,125.26

(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	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

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(%)
恒生电子股份有限公司	业务平台采购款	4,626,392.73	13.63
重庆龙湖嘉凯地产开发有限公司	购房款	3,794,400.00	11.18
北京信诚华远投资顾问有限公司	预付租金	1,917,964.00	5.65
四川福盛建设工程有限公司	工程款	1,004,747.89	2.96
崔稷宁	其他	925,882.65	2.73
小计		12,269,387.27	36.15

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	1,658,711,420.65	2,778,050,632.25
证券经纪业务	875,448,001.32	1,142,140,212.84
其中：代理买卖证券业务	736,706,195.97	995,815,884.74
交易单元席位租赁	122,300,998.53	124,200,773.14

代销金融产品业务	16,440,806.82	22,123,554.96
投资银行业务	643,434,938.64	1,462,275,045.26
其中：证券承销业务	357,807,604.16	885,251,613.28
证券保荐业务	26,056,603.77	58,081,132.07
财务顾问业务	259,570,730.71	518,942,299.91
资产管理业务	137,851,987.80	167,762,648.27
基金管理业务		2,097,268.35
投资咨询业务	1,976,492.89	3,775,457.53
手续费及佣金支出	314,895,042.40	441,349,680.68
证券经纪业务	227,751,884.36	299,817,552.28
其中：代理买卖证券业务	227,664,434.27	299,817,552.28
代销金融产品业务	87,450.09	
投资银行业务	67,126,721.42	137,197,381.76
其中：证券承销业务	41,557,941.51	73,471,212.50
证券保荐业务	3,562,125.64	8,455,523.87
财务顾问业务	22,006,654.27	55,270,645.39
资产管理业务	20,016,436.62	4,334,746.64
手续费及佣金净收入	1,343,816,378.25	2,336,700,951.57
其中：财务顾问业务净收入	237,564,076.44	463,671,654.52
—并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	79,600,293.26	177,264,162.94
—并购重组财务顾问业务净收入—其他	102,010,162.96	202,575,018.53
—其他财务顾问业务净收入	55,953,620.22	83,832,473.05

(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	804,829,381.10	6,053,002.61	4,194,977,546.90	17,112,830.25
银行理财产品	633,280,000.00	4,762,805.11	331,421,000.00	1,351,986.10
信托	482,700,000.00	3,630,315.22	72,300,000.00	294,937.84
其他	265,220,468.95	1,994,683.88	824,590,000.00	3,363,800.77
小 计	2,186,029,850.05	16,440,806.82	5,423,288,546.90	22,123,554.96

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	1,138,454,000.48	1,232,392,419.26
存放金融同业利息收入	435,630,168.25	483,460,352.27
其中：自有资金存款利息收入	195,958,687.85	170,747,222.37
客户资金存款利息收入	239,671,480.40	312,713,129.90
融资融券利息收入	579,774,870.29	597,618,313.52
买入返售金融资产利息收入	123,048,961.94	151,313,753.47

其中：约定购回利息收入	9,381,924.81	14,377,065.90
股权质押回购利息收入	89,158,504.22	87,029,027.19
利息支出	1,149,191,198.84	1,282,605,455.30
客户资金存款利息支出	42,747,987.30	57,490,610.12
卖出回购金融资产利息支出	425,612,831.04	399,990,953.03
其中：报价回购利息支出	1,385,441.59	1,791,041.06
短期借款利息支出	153,330,320.38	263,776,027.32
拆入资金利息支出	6,420,717.04	14,392,436.15
其中：转融通利息支出	99,578.15	3,361,750.00
应付债券利息支出	305,584,819.01	261,549,476.15
次级债券利息支出	215,494,524.07	215,656,061.73
其他		69,749,890.80
利息净收入	-10,737,198.36	-50,213,036.04

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	192,997,852.10	151,874,016.03
成本法核算的长期股权投资收益	195,465,947.88	2,845,382.07
金融工具投资收益	1,295,108,284.56	1,140,993,877.22
其中：持有期间取得的收益	752,989,294.22	1,150,147,992.25
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	643,852,496.98	678,824,113.94
—可供出售金融资产	113,379,691.16	443,018,923.17
—衍生金融工具	-4,242,893.92	28,304,955.14
处置金融工具取得的收益	542,118,990.34	-9,154,115.03
—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	86,292,090.93	22,158,831.58
—可供出售金融资产	489,430,827.72	19,210,699.40
—衍生金融工具	-33,603,928.31	-50,523,646.01
合 计	1,683,572,084.54	1,295,713,275.32

(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的原因
银华基金管理股份有限公司	192,997,852.10	151,874,016.03	被投资单位业绩上升
小 计	192,997,852.10	151,874,016.03	

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	-172,056,839.08	-216,482,338.97
衍生金融工具	-24,991,482.86	67,184,434.08
合 计	-197,048,321.94	-149,297,904.89

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	上年同期数
收回存出保证金	225,524,212.88	879,240,986.96
政府补助	2,436,796.26	18,035,539.78
清算款项	404,385,895.08	
其 他	22,536,990.93	15,240,223.60
合 计	654,883,895.15	912,516,750.34

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	上年同期数
衍生金融工具亏损	37,846,822.23	22,218,690.86
付现费用	471,483,885.81	238,350,471.87
行政罚款	36,000,000.00	
合 计	545,330,708.04	260,569,162.73

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	上年同期数
处置固定资产收到的现金	4,137,192.02	4,031,379.82
合 计	4,137,192.02	4,031,379.82

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
重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司	49,093,855.17	-906,144.83

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	从事投资业务	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	贷款、票据贴现及资产转让		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	期货经纪、投资咨询、资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司	重庆	重庆	基差交易、仓单服务、合作套保、定价服务		100.00	设立
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	提供股权登记、托管、挂牌、交易、结算及投融资提供场所和服务	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、计算机软件的技术开发及系统服务		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

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

对于本公司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，本公司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%	7,775,963.75	4,847,161.32	122,719,487.23

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	103,012,210.58	424,167,424.14	527,179,634.72	265,756,042.57	710,312.76	266,466,355.33	123,494,725.17	528,593,869.21	652,088,594.38	397,048,134.21	1,140,992.76	398,189,126.97

单位：元 币种：人民币

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	68,448,793.26	16,470,468.19	17,126,921.16	-4,618,209.54	126,693,860.23	72,491,823.38	70,570,056.42	4,479,289.72

(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	44.10		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
资产合计	2,991,911,140.09	2,537,778,628.31
负债合计	804,692,810.71	740,600,965.75
少数股东权益		38,085,623.89
归属于母公司股东权益	2,187,218,329.38	1,759,092,038.67
按持股比例计算的净资产份额	964,563,283.26	861,955,098.94
调整事项	684,008,184.23	760,009,093.61
--商誉	892,261,060.27	991,401,178.09
--减值准备	-208,252,876.04	-231,392,084.48
对联营企业权益投资的账面价值	1,648,571,467.49	1,621,964,192.55
营业收入	1,657,601,549.59	1,609,811,167.25
净利润	400,915,952.29	326,260,535.96
其他综合收益	-1,588,747.39	1,194,831.63
综合收益总额	399,327,204.90	327,455,367.59
本年度收到的来自联营企业的股利	80,887,503.66	156,313,134.98

(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

2017 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。

2017 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 2017 年 12 月 31 日的受托资产总额为 104,584,796,456.93 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	1,970,830,019.77	3,016,411,978.56	1,970,830,019.77	3,016,411,978.56

(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			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
一、持续的公允价值计量				
(一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	6,012,320,288.24	16,344,259,009.53		22,356,579,297.77
1. 交易性金融资产	6,012,320,288.24	16,344,259,009.53		22,356,579,297.77
(1) 债务工具投资	759,212,177.81	14,764,939,178.43		15,524,151,356.24
(2) 权益工具投资	5,253,108,110.43	1,579,319,831.10		6,832,427,941.53
(3) 衍生金融资产				
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(二) 可供出售金融资产	3,061,945,206.69	5,167,077,739.15		8,229,022,945.84
(1) 债务工具投资	1,760,252.91	779,550,535.87		781,310,788.78
(2) 权益工具投资	3,060,184,953.78	4,387,527,203.28		7,447,712,157.06
(三) 投资性房地产				
(四) 生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	9,074,265,494.93	21,511,336,748.68		30,585,602,243.61
(五) 衍生金融负债		68,737,082.55		68,737,082.55
(六) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		4,492,139,574.10		4,492,139,574.10
持续以公允价值计量的负债总额		4,560,876,656.65		4,560,876,656.65
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

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

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

本企业重要的合营或联营企业详见附注

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
中建投信托有限责任公司	公司前董事任该企业的高级管理人员
银华财富资本管理（北京）有限公司	联营企业的子公司
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

注：重庆三峡银行股份有限公司、益民基金管理有限公司及重庆国际信托股份有限公司本期已不属于公司关联方。

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

本公司作为出租方:

适用 不适用

公司出租交易席位给关联方并收取席位租赁费情况:

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	1,213.07	1,477.75
益民基金管理有限公司		88.94

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 23 人(包括离任人员), 本年度应付薪酬总额为 524.77 万元, 实际发放薪酬总额 587.29 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	85.06	124.75

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

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
重庆银行股份有限公司	598.45	231.59
重庆市城市建设投资（集团）有限公司	19.18	21.91
重庆三峡银行股份有限公司		2,063.41

4) 金融产品承销服务

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	359.32	300.00

5) 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
中建投信托有限责任公司		51.85
重庆银行股份有限公司	726.34	
重庆农村商业银行股份有限公司	493.36	
重庆三峡银行股份有限公司		15.34
银华基金管理股份有限公司	19.65	43.37

6) 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
-------	-----	-----

银华财富资产管理（北京）有限公司	46.79	14.26
------------------	-------	-------

7) 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

8) 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	160,000.00	50,000.00
重庆银行股份有限公司	5,000.00	

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

(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

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。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) 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

公司全资子公司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, 现已收回本金 1,003.42 万元。

3) 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

公司全资子公司重庆西证小额贷款有限公司 2016 年 7 月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)有限公司所欠重庆西证小额贷款有限公司的借款本金 1,000 万元、利息、罚息及复利。2016 年 9 月, 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, 现收回本金 14.41 万元。

(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 2017 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	282,255,456.20
经审议批准宣告发放的利润或股利	282,255,456.20

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

截至 2018 年 3 月 31 日，公司无其他应披露未披露的资产负债表日后事项。

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和流动性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，在风险和收益之间取得适当平衡。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》、《风险控制指标动态监控管理办法》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，对子公司通过业务指导、运营支持、决策管理等不同模式进行垂直风险管理，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，负责审议批准公司风险管理制度、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办公室负责，洗钱风险由法律合规部负责。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 284.99%，最低为 130.32%；

约定购回业务整体履约保障比例为 214.09%，最低为 157.60%；股票质押回购业务整体履约保障比为 218.43%，最低为 160.58%，担保物价值能够完全覆盖信用负债。

对债券类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：元 币种：人民币

涉及信用风险科目	期末数	期初数
货币资金	13,407,989,462.69	18,127,767,345.59
结算备付金	2,535,032,483.51	3,592,111,154.87
存出保证金	307,274,690.77	625,158,757.97
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	18,320,958,171.43	18,080,530,658.69
融出资金	8,763,744,996.81	8,041,862,035.04
衍生金融资产		5,451,641.47
买入返售金融资产	3,065,297,010.00	2,945,409,505.66
应收款项	50,247,697.25	197,767,003.24
应收利息	512,922,375.64	538,898,651.77
可供出售金融资产	1,889,212,121.20	3,849,977,949.25
持有至到期投资		99,441,565.00
其他资产中的金融资产	508,634,506.26	463,192,621.52
合计	49,361,313,515.56	56,567,568,890.07

综上，公司对各业务的信用风险进行了全面的监控管理，并采取相应的风险缓释措施和应对手段将信用风险控制在合理的范围之内。

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、回购等业务由资金管理部集中管理，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 2017 年末公司风险覆盖率 211.53%、资本杠杆率 25.30%、流动性覆盖率 469.04%、净稳定资金率 145.38%，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，包括汇率风险、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。

由于目前公司持有的外币资产及负债占整体的资产及负债比例不大，公司认为面临的汇率风险较小，因此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	6,581	6,581	2,788	3,930
利率敏感型金融工具	2,396	3,679	1,370	3,143
整体组合	6,791	6,791	2,922	4,800

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 2017 年 12 月 31 日，公司债券组合久期 2.48，基点价值 276.40 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	276,402,904.00	247,063,645.00
上升 100 个基点	-276,402,904.00	-247,063,645.00

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，公司的报告分部为：经纪业务、自营业务、投资银行业务、资产管理业务及其他业务。

(2) 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

2017 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	分部间抵销	合计
一、营业收入	1,334,402,079.09	1,059,242,953.41	569,215,407.20	108,721,079.03	-10,816,756.63		3,060,764,762.10
其中：1. 手续费及佣金净收入	725,990,163.20	-56,997,332.26	569,215,407.20	108,436,134.25	78,180,109.65		1,424,824,482.04
2. 其他收入	608,411,915.89	1,116,240,285.67		284,944.78	-88,996,866.28		1,635,940,280.06
二、营业支出	871,933,610.68	140,524,696.77	380,328,695.18	99,121,812.87	682,648,657.59		2,174,557,473.09
三、营业利润	462,468,468.41	918,718,256.64	188,886,712.02	9,599,266.16	-693,465,414.22		886,207,289.01
四、资产总额	21,894,845,334.17	30,586,537,721.70	16,160,464.33	98,932,977.10	11,300,616,136.01	-202,799,039.77	63,694,293,593.54
五、负债总额	12,785,703,688.28	11,662,856,141.87	425,198,589.17	34,725,779.64	18,737,147,841.06		43,645,632,040.02
六、补充信息							
1. 折旧和摊销费用	53,313,782.19	293,971.46	6,140,645.18	660,584.29	94,924,609.89		155,333,593.01
2. 资本性支出	102,200,429.45	331,642.43	2,764,075.32	1,761,295.42	64,061,681.25		171,119,123.87

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	分部间抵销	合计
一、营业收入	1,347,481,558.53	865,079,628.39	1,219,814,961.81	134,627,466.26	64,758,400.76		3,631,762,015.75
其中：1. 手续费及佣金净收入	988,960,766.07	-76,625,878.21	1,235,394,447.78	134,462,358.34	131,006,739.40		2,413,198,433.38
2. 其他收入	358,520,792.46	941,705,506.60	-15,579,485.97	165,107.92	-66,248,338.64		1,218,563,582.37
二、营业支出	962,252,649.42	220,700,427.82	581,790,623.50	120,656,988.61	588,663,522.05		2,474,064,211.40
三、营业利润	385,228,909.11	644,379,200.57	638,024,338.31	13,970,477.65	-523,905,121.29		1,157,697,804.35
四、资产总额	24,863,672,210.32	32,690,189,264.28	314,429,031.52	100,228,863.67	13,495,268,793.01	-464,096,117.67	70,999,692,045.13
五、负债总额	16,564,550,209.86	12,534,851,904.00	25,977,201.34	16,398,331.47	22,190,130,427.34		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

注：公司根据管理需要，对业务分部管理进行了部分调整，并追溯调整了比较期间数据。

(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）	21,534,339,752.67	-159,691,435.12			22,356,579,297.77
2、衍生金融工具	-174,215,314.41	80,120,707.60			-68,737,082.55
3、可供出售金融资产	10,876,585,466.99		379,728,108.73	75,276,540.55	8,229,022,945.84
金融资产小计	32,236,709,905.25	-79,570,727.52	379,728,108.73	75,276,540.55	30,516,865,161.06
上述合计	32,236,709,905.25	-79,570,727.52	379,728,108.73	75,276,540.55	30,516,865,161.06
金融负债	5,490,490,745.17	2,434,299.46			4,492,139,574.10

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）	354,864,169.98	47,938,666.03			660,580,734.40
2、衍生金融资产	5,233,962.80				
3、贷款和应收款	36,765.33				131,756,783.34
4、可供出售金融资产	284,461,446.60				1,042,199.28
金融资产小计	644,596,344.71	47,938,666.03			793,379,717.02
金融负债	167,477,025.71	105,373,830.46			62,708,477.58

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
非流动资产处置损益	-102,751.22
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）	17,702,396.26
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-43,570,042.57
其他符合非经常性损益定义的损益项目	
所得税影响额	-2,272,949.94
少数股东权益影响额（税后）	-872,481.98
合计	-29,115,829.45

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

□适用 √不适用

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（元/股）	稀释每股收益（元/股）
归属于公司普通股股东的净利润	3.49	0.12	0.12
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	3.65	0.12	0.12

(1) 加权平均净资产收益率的计算过程

单位：元 币种：人民币

项目	序号	本期数	
归属于公司普通股股东的净利润	A	668,800,161.74	
非经常性损益	B	-29,115,829.45	
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	697,915,991.19	
归属于公司普通股股东的期初净资产	D	19,001,272,142.71	
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（月）	F		
回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产	G	564,510,912.40	
减少净资产次月起至报告期期末的累计月数（月）	H	8	
其他	其他综合收益影响	I1	362,991,094.06
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数（月）	J1	6
	权益法核算的被投资单位增资导致的长期股权投资账面价值变动	I2	-84,724,587.28
	增减净资产次月起至报告期期末的累计月数（月）	J2	0
报告月份数	K	12	
加权平均净资产	$L = \frac{D+A}{2} + E \times \frac{F}{K} - G \times \frac{H}{K} \pm I \times \frac{J}{K}$	19,140,827,162.34	
加权平均净资产收益率（%）	$M = A/L$	3.49	
扣除非经常损益加权平均净资产收益率（%）	$N = C/L$	3.65	

(2) 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

1) 基本每股收益的计算过程

单位：元 币种：人民币

项 目	序号	本期数
归属于公司普通股股东的净利润	A	668,800,161.74
非经常性损益	B	-29,115,829.45
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	697,915,991.19
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(月)	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(月)	I	
报告期缩股数	J	
报告期月份数(月)	K	
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	$M=A/L$	0.12
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.12

2) 稀释每股收益的计算过程

稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

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2017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2017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：2018年3月30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	2017 年 5 月	中国证监会重庆监管局向公司下发了《关于核准张刚、赵天才等人证券公司董监事任职资格的批复》（渝证监许可[2017]2 号），核准张刚、万树斌证券公司董事；赵如冰、傅达清、罗炜证券公司独立董事；赵天才、李波证券公司监事任职资格。
2	章程变更	2017 年 10 月	中国证监会重庆监管局向公司下发了《关于核准西南证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（渝证监许可[2017]4 号，以下简称《批复》），核准公司变更《西南证券股份有限公司章程》的重要条款。

二、监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

年度	分类结果
2017	C 类 C 级
2016	A 类 A 级
2015	A 类 AA 级