

国元证券股份有限公司

2013 年第三季度报告

2013 年 10 月

第一节 重要提示

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

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司董事长蔡咏先生、总裁俞仕新先生、总会计师高民和先生及财务会计部总经理司开铭先生声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 主要财务数据及股东变化

一、主要会计数据和财务指标

公司是否因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述以前年度会计数据

是 否

| | 本报告期末 | 上年度末 | 本报告期末比上年度末增减 (%) | |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| 总资产 (元) | 28,426,271,972.82 | 22,885,957,499.34 | 24.21% | |
| 归属于上市公司股东的净资产 (元) | 15,412,733,918.30 | 14,944,901,580.11 | 3.13% | |
| | 本报告期 | 本报告期比上年同期增减 (%) | 年初至报告期末 | 年初至报告期末比上年同期增减 (%) |
| 营业收入 (元) | 540,569,944.43 | 73.06% | 1,391,197,993.63 | 20.33% |
| 归属于上市公司股东的净利润 (元) | 230,594,198.26 | 211.93% | 526,367,554.67 | 42.02% |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润 (元) | 231,957,447.78 | 213.77% | 528,384,409.15 | 42.38% |
| 经营活动产生的现金流量净额 (元) | -- | -- | -6,905,395,548.89 | --- |
| 基本每股收益 (元/股) | 0.12 | 200.00% | 0.27 | 42.02% |
| 稀释每股收益 (元/股) | 0.12 | 200.00% | 0.27 | 42.02% |
| 加权平均净资产收益率 (%) | 1.51% | 增长 1.01 个百分点 | 3.47% | 增加 0.97 个百分点 |

公司报告期末到季度报告披露日股本是否因发行新股、增发、配股、股权激励行权、回购等原因发生且影响所有者权益金额

是 否

非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元

| 项目 | 年初至报告期末金额 | 说明 |
|--|-------------|----|
| 非流动资产处置损益 (包括已计提资产减值准备的冲销部分) | -154,101.51 | |
| 越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免 | | |
| 计入当期损益的政府补助 (与企业业务密切相关, 按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外) | 723,855.44 | |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | | |
| 企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益 | | |

| | | |
|---|---------------|----|
| 非货币性资产交换损益 | | |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | | |
| 因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备 | | |
| 债务重组损益 | | |
| 企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等 | | |
| 交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益 | | |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益 | | |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益 | | |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 | | |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回 | | |
| 对外委托贷款取得的损益 | | |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益 | | |
| 根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响 | | |
| 受托经营取得的托管费收入 | | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | -3,007,643.94 | |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目 | | |
| | | |
| 减: 所得税影响额 | -421,035.53 | |
| 少数股东权益影响额(税后) | | |
| 合计 | -2,016,854.48 | -- |

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

| 项目 | 涉及金额(元) | 原因 |
|--|----------------|---|
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售 | 322,944,052.39 | 根据中国证券监督管理委员会公告[2008]43号《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[2008]》第14条规定:除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益,视为非经常性损益项目。由于本公司属于金融行业中的证券业,主要的业务经营范围为:证券经纪;证券投资咨 |

| | | |
|--------------|--|--|
| 售金融资产取得的投资收益 | | 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；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品等。因此本公司根据自身正常经营业务的性质和特点将持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益作为经常性损益项目，不在非经常性损益计算表中列示。其中：处置交易性金融资产、可供出售金融资产取得的投资收益 340,536,371.63 元，持有交易性金融资产产生的公允价值变动损益-17,592,319.24 元。 |
|--------------|--|--|

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末股东总数 | 101,526 | | | | | |
|-------------------------------|-------------|----------|-------------|--------------|---------|-------------|
| 前 10 名股东持股情况 | | | | | | |
| 股东名称 | 股东性质 | 持股比例 (%) | 持股数量 | 持有有限售条件的股份数量 | 质押或冻结情况 | |
| | | | | | 股份状态 | 数量 |
| 安徽国元控股(集团)有限责任公司 | 国有法人 | 23.55% | 462,498,033 | 0 | 质押 | 41,000,000 |
| 安徽国元信托有限责任公司 | 国有法人 | 15.69% | 308,104,975 | 0 | | |
| 安徽省粮油食品进出口(集团)公司 | 国有法人 | 12.52% | 245,843,732 | 0 | 质押 | 120,000,000 |
| 安徽省皖能股份有限公司 | 国有法人 | 5.01% | 98,303,300 | 0 | | |
| 安徽皖维新材料股份有限公司 | 国有法人 | 3.13% | 61,505,369 | 0 | | |
| 安徽全柴集团有限公司 | 国有法人 | 2.99% | 58,740,055 | 0 | | |
| 合肥兴泰控股集团有限公司 | 国有法人 | 1.31% | 25,664,621 | 0 | | |
| 中国银行-易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 | 境内非国有法人 | 0.88% | 17,277,430 | 0 | | |
| 全国社保基金一一零组合 | 境内非国有法人 | 0.77% | 15,116,148 | 0 | | |
| 魏兆琪 | 境内自然人 | 0.69% | 13,543,050 | 0 | | |
| 前 10 名无限售条件股东持股情况 | | | | | | |
| 股东名称 | 持有无限售条件股份数量 | 股份种类 | | | | |
| | | 股份种类 | 数量 | | | |
| 安徽国元控股(集团)有限责任公司 | 462,498,033 | 人民币普通股 | 462,498,033 | | | |
| 安徽国元信托有限责任公司 | 308,104,975 | 人民币普通股 | 308,104,975 | | | |
| 安徽省粮油食品进出口(集团)公司 | 245,843,732 | 人民币普通股 | 245,843,732 | | | |

| | | | |
|-------------------------------|---|--------|------------|
| 安徽省皖能股份有限公司 | 98,303,300 | 人民币普通股 | 98,303,300 |
| 安徽皖维高新材料股份有限公司 | 61,505,369 | 人民币普通股 | 61,505,369 |
| 安徽全柴集团有限公司 | 58,740,055 | 人民币普通股 | 58,740,055 |
| 合肥兴泰控股集团有限公司 | 25,664,621 | 人民币普通股 | 25,664,621 |
| 中国银行－易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 | 17,277,430 | 人民币普通股 | 17,277,430 |
| 全国社保基金一一零组合 | 15,116,148 | 人民币普通股 | 15,116,148 |
| 魏兆琪 | 13,543,050 | 人民币普通股 | 13,543,050 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 安徽国元控股（集团）有限责任公司、安徽国元信托有限责任公司互为一致行动人，未知其他股东之间是否存在关联关系或属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。 | | |
| 参与融资融券业务股东情况说明（如有） | 魏兆琪通过中信建投证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户持有公司股份 13,543,050 股，持股比例为 0.69%。 | | |

公司股东在报告期内是否进行约定购回交易

是 否

第三节 重要事项

一、报告期主要会计报表项目、财务指标发生重大变动的情况及原因

单位：元

| 项目 | 2013年9月30日 | 2012年12月31日 | 增减百分比 % | 主要原因 |
|---------------------|------------------|------------------|------------|-----------------------------|
| 结算备付金-信用备付金 | 193,122,655.98 | 113,818,693.13 | 69.68% | 存放结算机构的交易资金增加所致 |
| 融出资金 | 3,829,758,849.41 | 1,084,886,166.63 | 253.01% | 融出资金规模大幅增加所致 |
| 融出证券 | 24,153,366.87 | 5,616,674.00 | 330.03% | 融出证券规模大幅增加所致 |
| 交易性金融资产 | 529,198,541.70 | 352,541,508.99 | 50.11% | 交易性的自营投资规模增加所致 |
| 买入返售金融资产 | 2,255,954,182.49 | 1,087,390,948.47 | 107.46% | 约定购回式证券、股票质押式回购等类贷款业务大幅增加所致 |
| 应收利息 | 287,540,207.75 | 119,288,452.68 | 141.05% | 融出资金规模增加和买入债券等大幅增加所致 |
| 存出保证金 | 199,295,348.16 | 337,956,966.95 | -41.03% | 交易所调整保证金缴存比例所致 |
| 可供出售金融资产 | 8,707,391,705.50 | 5,316,280,773.13 | 63.79% | 公司债券投资和子公司金融资产投资规模增加所致 |
| 递延所得税资产 | 69,427,439.75 | 124,202,680.49 | -44.10% | 可供出售金融资产价值回升所致 |
| 卖出回购金融资产款 | 1,413,391,250.00 | 69,214,000.00 | 1942.06% | 债券正回购资金大幅增加所致 |
| 应付债券 | 4,974,260,523.83 | | | 本报告期发行债券所致 |
| 应付利息 | 45,256,439.87 | 703,430.15 | 6333.68% | 公司7月份发行债券计提利息所致 |
| 递延所得税负债 | 32,617,137.24 | 13,947,230.93 | 133.86% | 计提应收未收到的金融产品收益所致 |
| 项目 | 2013年1-9月 | 2012年1-9月 | 增减百分比 % | 主要原因 |
| 手续费及佣金净收入-代理买卖业务净收入 | 651,133,962.43 | 444,489,918.13 | 46.49% | 证券经纪业务交易量大幅增加导致佣金增加所致 |
| 手续费及佣金净收入-证券承销业务净收入 | 36,774,394.90 | 63,348,480.66 | -41.95% | IPO暂停影响导致收入大幅下降 |
| 手续费及佣金净收入-资产管理业务净收入 | 19,403,181.32 | 10,296,098.80 | 88.45% | 公司资产管理规模增加所致 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 413,409,984.22 | 244,374,862.64 | 69.17% | 公司买入金融资产产品规模增加导致收益增加 |

| | | | | |
|---------------------|-------------------|-------------------|----------|----------------------------|
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -25,979,683.00 | 15,428,459.80 | -268.39% | 持有交易性金融资产浮亏增加以及处置交易性证券结转所致 |
| 资产减值损失 | 1,399,507.69 | 111,853.11 | 1151.20% | 计提坏账损失大幅增加所致 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -6,905,395,548.89 | -2,259,185,759.85 | | -购买金融资产与融出资金大幅增加所致 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -42,261,307.06 | -79,277,125.18 | | -对外投资与购买固定资产减少所致 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 4,776,570,000.00 | -196,410,000.00 | | -公司2013年7月份发行面值50亿元的债券所致 |

二、重要事项进展情况及影响和解决方案的分析说明

1、2009年2月14日，公司第五届董事会第十四次会议审议通过了《关于追加办公楼购置预算的议案》，同意公司追加购置办公楼预算8,139万元，具体内容见公司于2009年2月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网披露的《关于追加办公楼购置预算的公告》，2011年6月15日，公司与安徽饭店签署了《商品房买卖合同》，该商品房合同约定建筑面积共28,817.32平方米，总价237,600,561元。本次购置的办公场所，是依照当时的市场价格进行作价，分五期付款，截至本报告期末，公司已支付21,779.11万元购房款，该商品房正在建设当中。

2、2013年1月28日，公司2013年第一次临时股东大会审议通过了《关于向国元创新投资有限公司增资的议案》，同意向国元创新投资有限公司增资15亿元，具体详见2013年1月29日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。截止2013年3月底，公司已完成对国元创新投资有限公司的增资事宜。

3、2013年2月5日，公司第六届董事会第二十二次会议审议通过了《关于使用部分闲置募集资金暂时补充流动资金的议案》，同意公司使用部分闲置募集资金80,000万元暂时补充流动资金，使用期限自2013年2月6日起不超过12个月，到期及时归还至募集资金专用账户。截止2013年2月底，80,000万元已全部补充流动资金。

4、2013年4月12日，公司全资子公司国元期货有限公司换发了新的营业执照，地址变更为：北京市东城区东直门外大街46号1号楼19层1901。

5、2013年4月16日，公司2012年度股东大会审议通过了《关于公司公开发行公司债券的议案》，发行事宜需报监管部门核准后实施，具体详见2013年4月17日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。经中国证监会证监许可〔2013〕846号文核准，公司获准向社会公开发行面值不超过50亿元（含50亿元）的公司债券，公司公开发行2013年公司债券（以下简称“本期债券”）发行总额为人民币50亿元，发行价格为每张人民币100元，采取网上面向社会公众投资者公开发行和网下面向机构投资者

询价配售相结合的方式发行。2013年7月26日，本期债券成功发行，其中3+2年期品种发行规模为人民币32.7亿元，票面利率为4.7%；5年期品种发行规模为人民币17.3亿元，利率为4.9%。本期债券于2013年8月12日起在深交所挂牌交易，债券简称为“13国元01”、“13国元02”，上市代码为“112186”、“112187”。

6、2013年6月24日，公司召开第六届董事会第三十次会议审议通过了《关于参股安徽省股权托管交易中心有限责任公司（拟定名）的议案》，具体详见2013年6月25日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。2013年8月1日，安徽省股权托管交易中心有限责任公司完成了工商登记事宜，2013年9月30日，该公司正式揭牌运营。

7、公司第六届董事会、第六届监事会任期于2013年10月25日届满，公司于2013年9月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网刊登了《关于公司董事会换届选举的公告》和《关于公司监事会换届选举的公告》。根据《公司法》、《公司章程》等相关规定，公司于2013年10月28日召开了相关的股东大会和董事会，完成了换届选举的相关事宜，具体公告详见2013年10月29日和2013年10月30日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。

三、公司或持股 5%以上股东在报告期内发生或以前期间发生但持续到报告期内的承诺事项

适用 不适用

四、对 2013 年度经营业绩的预计

预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及原因说明

适用 不适用

五、证券投资情况

| 证券品种 | 证券代码 | 证券简称 | 最初投资成本 (元) | 期初持股数 量(股) | 期初持股 比例(%) | 期末持股数 量(股) | 期末持股 比例(%) | 期末账面值 (元) | 报告期损益 (元) | 会计核算 科目 | 股份 来源 |
|------|--------|---------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|----------------|-------------|----------|
| 可转债 | 113002 | 工行转债 | 364,086,720.72 | 0 | 0% | 3,116,310.00 | 1.25% | 345,598,779.00 | -18,487,941.72 | 交易性金 融资产 | 购买 |
| 基金 | | 国元多策 略中国机 会基金 | 36,168,572.13 | 45,867.08 | 100% | 40,470.94 | 100% | 43,608,151.38 | 80,905.25 | 交易性金 融资产 | 购买 |
| 企业债 | 122633 | 12 嘉兴经 投债 | 40,390,560.00 | 0 | 0% | 400,000.00 | 4.44% | 39,984,000.00 | -406,560.00 | 交易性金 融资产 | 购买 |
| 基金 | | 国元环球 中国机会 基金 | 23,950,284.48 | 369,215.71 | 38.64% | 369,215.71 | 38.37% | 37,382,905.35 | 5,761,415.65 | 交易性金 融资产 | 购买 |
| 企业债 | 122577 | 12 苏州相 | 30,822,210.00 | 0 | 0% | 300,000.00 | 1.67% | 30,342,000.00 | -480,210.00 | 交易性金 | 购买 |

| | | | | | | | | | | | |
|----------------------|-------|------|------------------|------------|----|--------------|----|----------------|----------------|---------|----|
| | | 城债 | | | | | | | | 融资产 | |
| 股票 | 02319 | 蒙牛乳业 | 3,869,548.00 | 0 | 0% | 150,000.00 | 0% | 4,132,834.88 | 263,286.87 | 交易性金融资产 | 购买 |
| 股票 | 00175 | 吉利汽车 | 3,958,032.83 | 0 | 0% | 1,200,000.00 | 0% | 3,796,261.56 | -161,771.27 | 交易性金融资产 | 购买 |
| 股票 | 00623 | 中视金桥 | 2,490,025.42 | 0 | 0% | 500,000.00 | 0% | 2,671,971.90 | 181,946.48 | 交易性金融资产 | 购买 |
| 股票 | 06863 | 辉山乳业 | 1,806,904.74 | 0 | 0% | 895,000.00 | 0% | 1,681,637.63 | -125,267.11 | 交易性金融资产 | 购买 |
| 期末持有的其他证券投资 | | | 20,000,000.00 | | -- | | -- | 20,000,000.00 | | -- | -- |
| 合计 | | | 527,542,858.32 | 415,082.79 | -- | 6,970,996.65 | -- | 529,198,541.70 | -13,374,195.85 | -- | -- |
| 证券投资审批董事会公告披露日期 | | | 2013 年 02 月 06 日 | | | | | | | | |
| 证券投资审批股东会公告披露日期 (如有) | | | 不适用 | | | | | | | | |

注：本表填列合并报表中交易性金融资产科目核算的内容，其中国元多策略中国机会基金、国元环球中国机会基金、蒙牛乳业、吉利汽车、中视金桥、辉山乳业为公司子公司国元证券（香港）有限公司持有。

持有其他上市公司股权情况的说明

√ 适用 □ 不适用

单位：元

| 证券代码 | 证券简称 | 初始投资金额 | 占该公司股权比例 | 期末账面值 | 报告期损益 | 报告期所有者权益变动 | 会计核算科目 | 股份来源 |
|--------|------|----------------|----------|----------------|---------------|----------------|----------|------|
| 000333 | 美的集团 | 572,247,982.56 | 0.77% | 560,436,883.00 | 22,560,618.00 | 215,259,427.60 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 600183 | 生益科技 | 175,560,000.00 | 1.74% | 132,145,000.00 | 3,705,000.00 | 28,158,000.00 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 601818 | 光大银行 | 134,753,461.68 | 0.10% | 110,824,019.85 | 2,255,366.02 | -23,929,441.83 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 600867 | 通化东宝 | 79,587,265.65 | 0.52% | 84,647,148.19 | | 5,059,882.54 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 600887 | 伊利股份 | 65,403,078.78 | 0.08% | 74,981,395.16 | | 9,578,316.38 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 002555 | 顺荣股份 | 20,355,000.00 | 5.15% | 73,071,000.00 | 2,070,000.00 | -345,000.00 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 002007 | 华兰生物 | 39,403,231.99 | 0.25% | 41,243,697.00 | | 1,840,465.01 | 可供出售金融资产 | 购入 |
| 600597 | 光明乳业 | 21,375,112.35 | 0.09% | 26,540,047.45 | | 5,164,935.10 | 可供出售金融资产 | 购入 |

| | | | | | | | 融资产 | |
|--------|------|------------------|-------|------------------|---------------|----------------|---------------------------------|----|
| 601857 | 中国石油 | 40,449,983.43 | 0.00% | 27,831,004.32 | 323,246.36 | -4,117,847.60 | 可供出售金 融资产 | 购入 |
| 600104 | 上汽集团 | 35,865,442.82 | 0.02% | 26,180,550.00 | 1,161,000.00 | -9,684,892.82 | 可供出售金 融资产 | 购入 |
| | 其他 | 142,855,618.00 | | 113,057,922.34 | 1,571,863.44 | -15,641,184.76 | 可供出售金 融资产、融出 证券、被套期 项目 | 购入 |
| 合计 | | 1,327,856,177.26 | | 1,270,958,667.31 | 33,647,093.82 | 211,342,659.62 | | |

注：根据合并报表中可供出售金融资产、融出证券、被套期项目前十位填列，其余证券在其他项下合并列示。

买卖其他上市公司股份的情况

单位：元

| 股份名称 | 期初股份 数量 | 报告期买入股份数 量 | 报告期卖出股份数 量 | 期末股份数量 | 使用的资金数量 | 产生的投资收 益 |
|------|------------|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| 光大银行 | | 38,885,621.00 | | 38,885,621.00 | 134,753,461.68 | |
| 通化东宝 | | 4,801,313.00 | | 4,801,313.00 | 79,587,265.65 | |
| 伊利股份 | | 1,678,187.00 | | 1,678,187.00 | 65,403,078.78 | |
| 华兰生物 | | 1,464,100.00 | | 1,464,100.00 | 39,403,231.99 | |
| 同仁堂 | | 7,271,870.00 | 7,271,870.00 | | | 12,613,241.58 |

注：根据合并报表可供出售金融资产中买卖上市公司股份成交金额前五名的情况填列。

六、衍生品投资情况

单位：万元

| 衍生品投 资操作方 名称 | 关联关系 | 是否关联 交易 | 衍生品投 资类型 | 衍生品投 资初始投 资金额 | 起始日期 | 终止日期 | 期初投资 金额 | 计提减值 准备金额 (如有) | 期末投资 金额 | 期末投资 金额占公 司报告期 末净资产 比例(%) | 报告期实 际损益金 额 |
|--------------------------|------|------------|--------------|---------------------|------|------|------------|----------------------|------------|---------------------------------------|-------------------|
| 股指期货 | - | 否 | 股指期货 套期保值 | 36,362.41 | | | 0 | | 1,230.08 | 0.08% | -255.09 |
| 合计 | | | | 36,362.41 | -- | -- | 0 | | 1,230.08 | 0.08% | -255.09 |
| 衍生品投资资金来源 | | | | 自有资金 | | | | | | | |
| 涉诉情况(如适用) | | | | 无 | | | | | | | |
| 衍生品投资审批董事会公告披露日期 (如有) | | | | 2010年06月11日 | | | | | | | |
| 衍生品投资审批股东会公告披露日期 | | | | 不适用 | | | | | | | |

| | |
|---|---|
| (如有) | |
| 报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明(包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等) | 股指期货套期保值业务涉及的风险点主要集中在保证金管理、套期保值比率、各合约资金分配比例、强制减仓和强行平仓等方面。在日常风险管理中,公司运用金融工程技术,综合考虑相关因素,确定追加保证金金额、套期保值比率、各合约资金分配比例、强制减仓和强行平仓的应对措施等风险控制指标。公司股指期货套期保值业务为空头套期保值,专为公司融券券源做风险对冲。融资融券部每月最少一次对股指期货套保有效性进行评估,确保融券券源的跌价损失与股指期货套期保值对冲后的风险限额不超过公司实际融券券源市值×2.6%。如风险限额超过公司实际融券券源市值×1%时,融资融券部须及时调整套保策略及操作方案,每日评估有效性,修正偏差。 |
| 已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况,对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定 | 采用活跃市场中的报价来确定公允价值 |
| 报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明 | 报告期公司衍生品的会计政策及会计核算原则与上一报告期相比无重大变化。 |
| 独立董事对公司衍生品投资及风险控制情况的专项意见 | 不适用 |

注:衍生品初始投资金额、期末投资金额均为套期保值合约金额。

七、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

| 接待时间 | 接待地点 | 接待方式 | 接待对象类型 | 接待对象 | 谈论的主要内容及提供的资料 |
|-------------------------|------|------|--------|-----------|-----------------------|
| 2013年07月09日 | 公司 | 媒体采访 | 机构 | 证券时报记者李东亮 | 公司创新发展情况及未来发展规划,未提供资料 |
| 2013年07月01日至2013年09月30日 | 公司 | 电话沟通 | 个人 | 个人投资者 | 公司经营情况、行业状况等,未提供资料 |

第四节 财务报表

一、财务报表

1.1 资产负债表

资产负债表（一）

编制单位：国元证券股份有限公司

2013 年 9 月 30 日

单位：（人民币）元

| 项目 | 2013 年 9 月 30 日 | | 2012 年 12 月 31 日 | |
|-----------|------------------|------------------|-------------------|------------------|
| | 合并 | 母公司 | 合并 | 母公司 |
| 资产： | | | | |
| 货币资金 | 7,621,508,593.87 | 6,579,889,627.45 | 10,132,740,161.63 | 7,642,147,812.01 |
| 其中：客户资金存款 | 4,720,143,828.43 | 4,149,273,009.43 | 5,945,182,138.14 | 5,046,347,689.16 |
| 客户信用资金存款 | 438,201,426.65 | 189,211,412.51 | 434,338,286.26 | 120,369,329.82 |
| 结算备付金 | 1,262,137,934.75 | 1,119,044,330.22 | 934,694,892.96 | 801,678,165.05 |
| 其中：客户备付金 | 898,858,511.74 | 826,107,697.88 | 716,897,055.96 | 591,380,328.05 |
| 信用备付金 | 193,122,655.98 | 193,122,655.98 | 113,818,693.13 | 113,818,693.13 |
| 拆出资金 | | | | |
| 融出资金 | 3,829,758,849.41 | 3,530,784,972.20 | 1,084,886,166.63 | 906,405,613.09 |
| 融出证券 | 24,153,366.87 | 24,153,366.87 | 5,616,674.00 | 5,616,674.00 |
| 交易性金融资产 | 529,198,541.70 | 415,924,779.00 | 352,541,508.99 | 274,289,630.24 |
| 其中：抵押证券 | | | | |
| 衍生金融资产 | | | | |
| 买入返售金融资产 | 2,255,954,182.49 | 2,228,252,112.49 | 1,087,390,948.47 | 1,087,390,948.47 |
| 应收利息 | 287,540,207.75 | 198,895,535.73 | 119,288,452.68 | 118,390,813.78 |
| 存出保证金 | 199,295,348.16 | 14,472,264.16 | 337,956,966.95 | 134,051,551.94 |
| 可供出售金融资产 | 8,707,391,705.50 | 5,558,923,268.09 | 5,316,280,773.13 | 4,424,647,169.66 |
| 持有至到期投资 | | | | |
| 长期股权投资 | 897,971,006.90 | 5,386,838,902.23 | 902,752,212.43 | 3,868,830,107.76 |
| 投资性房地产 | | | | |
| 固定资产 | 1,469,534,274.94 | 1,459,225,517.38 | 1,476,093,845.86 | 1,464,905,121.21 |

| | | | | |
|-------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 无形资产 | 19,389,336.53 | 16,576,990.90 | 20,803,409.19 | 17,743,517.67 |
| 其中：交易席位费 | 1,974,407.05 | 1,221,339.12 | 1,535,689.64 | 1,535,689.64 |
| 递延所得税资产 | 69,427,439.75 | 65,212,530.15 | 124,202,680.49 | 117,352,803.11 |
| 其他资产 | 1,253,011,184.20 | 382,324,368.31 | 990,708,805.93 | 227,240,220.41 |
| 资产总计 | 28,426,271,972.82 | 26,980,518,565.18 | 22,885,957,499.34 | 21,090,690,148.40 |

法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

资产负债表（二）

编制单位：国元证券股份有限公司

2013 年 9 月 30 日

单位：（人民币）元

| 项目 | 2013 年 9 月 30 日 | | 2012 年 12 月 31 日 | |
|-------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 合并 | 母公司 | 合并 | 母公司 |
| 负债： | | | | |
| 短期借款 | | | | |
| 其中：质押借款 | | | | |
| 拆入资金 | | | 100,000,000.00 | 100,000,000.00 |
| 交易性金融负债 | | | | |
| 衍生金融负债 | 155,880.00 | 155,880.00 | | |
| 卖出回购金融资产款 | 1,413,391,250.00 | 1,413,391,250.00 | 69,214,000.00 | 69,214,000.00 |
| 代理买卖证券款 | 5,779,400,559.08 | 4,974,273,818.95 | 6,988,531,352.87 | 5,755,604,093.11 |
| 信用交易代理买卖证券款 | 521,023,084.17 | 252,237,160.36 | 480,392,222.18 | 120,269,062.05 |
| 代理承销证券款 | | | | |
| 应付职工薪酬 | 62,230,112.90 | 47,645,363.23 | 119,018,262.73 | 83,226,471.83 |
| 应交税费 | 80,876,743.66 | 55,023,411.79 | 77,974,348.94 | 59,713,767.60 |
| 应付利息 | 45,256,439.87 | 45,256,439.87 | 703,430.15 | 703,430.15 |
| 预计负债 | | | | |
| 长期借款 | | | | |
| 应付债券 | 4,974,260,523.83 | 4,974,260,523.83 | | |
| 递延所得税负债 | 32,617,137.24 | | 13,947,230.93 | 1,054,530.85 |
| 其他负债 | 104,326,323.77 | 83,733,011.75 | 91,275,071.43 | 74,264,385.33 |
| 负债合计 | 13,013,538,054.52 | 11,845,976,859.78 | 7,941,055,919.23 | 6,264,049,740.92 |
| 股东权益： | | | | |
| 股本 | 1,964,100,000.00 | 1,964,100,000.00 | 1,964,100,000.00 | 1,964,100,000.00 |
| 资本公积 | 9,810,211,404.16 | 9,766,424,087.22 | 9,659,208,383.96 | 9,620,530,283.72 |
| 减：库存股 | | | | |

| | | | | |
|---------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 盈余公积 | 605,047,897.00 | 605,047,897.00 | 605,047,897.00 | 605,047,897.00 |
| 一般风险准备 | 600,026,691.87 | 600,026,691.87 | 600,026,691.87 | 600,026,691.87 |
| 交易风险准备 | 559,016,447.49 | 559,016,447.49 | 559,016,447.49 | 559,016,447.49 |
| 未分配利润 | 1,945,923,329.03 | 1,639,926,581.82 | 1,615,965,774.36 | 1,477,919,087.40 |
| 外币报表折算差额 | -71,591,851.25 | | -58,463,614.57 | |
| 归属于母公司股东权益合计 | 15,412,733,918.30 | 15,134,541,705.40 | 14,944,901,580.11 | 14,826,640,407.48 |
| 少数股东权益 | | | | |
| 股东权益合计 | 15,412,733,918.30 | 15,134,541,705.40 | 14,944,901,580.11 | 14,826,640,407.48 |
| 负债和股东权益总计 | 28,426,271,972.82 | 26,980,518,565.18 | 22,885,957,499.34 | 21,090,690,148.40 |

法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

1.2 年初到报告期末利润表

编制单位：国元证券股份有限公司

2013 年 1-9 月

单位：（人民币）元

| 项 目 | 2013 年 1-9 月 | | 2012 年 1-9 月 | |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 合并数 | 母公司 | 合并数 | 母公司 |
| 一、营业收入 | 1,391,197,993.63 | 1,103,490,086.32 | 1,156,120,175.71 | 1,054,498,924.94 |
| 手续费及佣金净收入 | 730,615,373.64 | 671,295,811.30 | 532,443,706.84 | 491,731,435.27 |
| 其中：代理买卖业务净收入 | 651,133,962.43 | 602,573,138.54 | 444,489,918.13 | 409,595,587.15 |
| 证券承销业务净收入 | 36,774,394.90 | 36,774,394.90 | 63,348,480.66 | 63,348,480.66 |
| 委托客户资产管理业务净收入 | 19,403,181.32 | 15,497,598.21 | 10,296,098.80 | 4,478,158.21 |
| 保荐业务收入 | 9,700,000.00 | 9,700,000.00 | 10,400,000.00 | 10,400,000.00 |
| 财务顾问业务收入 | 2,920,000.00 | 2,920,000.00 | 3,900,000.00 | 3,900,000.00 |
| 利息净收入 | 268,575,442.43 | 197,863,209.95 | 354,569,345.04 | 310,166,958.03 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 413,409,984.22 | 262,412,807.75 | 244,374,862.64 | 240,315,828.44 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | 46,679,975.88 | 46,679,975.88 | 54,920,000.56 | 54,920,000.56 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -25,979,683.00 | -31,980,198.87 | 15,428,459.80 | 5,136,963.44 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | 426,566.66 | -188,335.52 | 1,877,175.74 | 41,294.19 |
| 其他业务收入 | 4,150,309.68 | 4,086,791.71 | 7,426,625.65 | 7,106,445.57 |
| 二、营业支出 | 725,370,423.26 | 657,873,398.02 | 705,629,957.94 | 650,457,161.89 |
| 营业税金及附加 | 43,734,974.91 | 39,031,899.15 | 42,140,951.71 | 40,568,733.02 |
| 业务及管理费 | 678,600,823.50 | 615,551,248.82 | 661,625,237.25 | 608,024,659.89 |
| 资产减值损失 | 1,399,507.69 | 1,655,132.89 | 111,853.11 | 111,853.11 |

| | | | | |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|
| 其他业务成本 | 1,635,117.16 | 1,635,117.16 | 1,751,915.87 | 1,751,915.87 |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | 665,827,570.37 | 445,616,688.30 | 450,490,217.77 | 404,041,763.05 |
| 加：营业外收入 | 1,278,487.44 | 1,268,913.71 | 1,744,085.46 | 1,743,007.52 |
| 减：营业外支出 | 3,716,377.45 | 3,653,774.92 | 2,313,867.87 | 2,306,329.92 |
| 四、利润总额（亏损总额“-”号填列） | 663,389,680.36 | 443,231,827.09 | 449,920,435.36 | 403,478,440.65 |
| 减：所得税费用 | 137,022,125.69 | 84,814,332.67 | 79,295,366.38 | 68,324,049.84 |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | 526,367,554.67 | 358,417,494.42 | 370,625,068.98 | 335,154,390.81 |
| 其中：归属于母公司所有者的净利润 | 526,367,554.67 | | 370,625,068.98 | |
| 少数股东损益 | | | | |
| 六、每股收益： | | | | |
| （一）基本每股收益 | 0.27 | | 0.19 | |
| （二）稀释每股收益 | 0.27 | | 0.19 | |
| 七、其他综合收益 | 137,874,783.52 | 145,893,803.50 | -108,161,168.90 | -109,910,389.02 |
| 八、综合收益合计 | 664,242,338.19 | 504,311,297.92 | 262,463,900.08 | 225,244,001.79 |
| 其中：归属于母公司所有者的综合收益总额 | 664,242,338.19 | | 262,463,900.08 | |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | | | |

法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

1.3 本报告期利润表

编制单位：国元证券股份有限公司

2013 年 7-9 月

单位：（人民币）元

| 项 目 | 2013 年 7-9 月 | | 2012 年 7-9 月 | |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 合并数 | 母公司 | 合并数 | 母公司 |
| 一、营业收入 | 540,569,944.43 | 428,764,764.44 | 312,364,703.04 | 288,886,665.17 |
| 手续费及佣金净收入 | 289,018,899.32 | 265,087,981.27 | 152,947,678.46 | 140,128,974.08 |
| 其中：代理买卖业务净收入 | 258,940,246.56 | 242,734,352.42 | 127,905,051.02 | 116,408,689.72 |
| 证券承销业务净收入 | 3,000,000.00 | 3,000,000.00 | 16,900,000.00 | 16,900,000.00 |
| 委托客户资产管理业务净收入 | 9,620,470.78 | 8,123,602.21 | 2,789,030.48 | 1,466,687.40 |
| 保荐业务收入 | 5,700,000.00 | 5,700,000.00 | 4,400,000.00 | 4,400,000.00 |
| 财务顾问业务收入 | 1,720,000.00 | 1,720,000.00 | 950,000.00 | 950,000.00 |
| 利息净收入 | 95,533,096.65 | 74,033,404.70 | 101,493,555.91 | 87,704,302.70 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 147,808,853.71 | 88,040,252.70 | 61,779,151.96 | 59,972,568.70 |

| | | | | |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | 11,739,831.23 | 11,739,831.23 | 9,803,697.18 | 9,803,697.18 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6,598,121.35 | -28,660.67 | -6,202,033.31 | -492,086.98 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | -92,984.03 | -42,980.19 | 755,244.49 | 19,724.25 |
| 其他业务收入 | 1,703,957.43 | 1,674,766.63 | 1,591,105.53 | 1,553,182.42 |
| 二、营业支出 | 240,589,458.95 | 217,616,757.29 | 222,085,548.88 | 203,359,928.66 |
| 营业税金及附加 | 16,241,309.06 | 14,597,293.02 | 12,777,373.94 | 12,171,620.26 |
| 业务及管理费 | 223,936,193.12 | 202,619,281.51 | 208,855,877.14 | 190,736,010.60 |
| 资产减值损失 | 11,774.01 | | | |
| 其他业务成本 | 400,182.76 | 400,182.76 | 452,297.80 | 452,297.80 |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | 299,980,485.48 | 211,148,007.15 | 90,279,154.16 | 85,526,736.51 |
| 加：营业外收入 | 1,194,285.63 | 1,194,285.63 | 659,639.57 | 658,561.63 |
| 减：营业外支出 | 2,980,602.64 | 2,980,569.66 | 818,376.49 | 818,349.35 |
| 四、利润总额（亏损总额“-”号填列） | 298,194,168.47 | 209,361,723.12 | 90,120,417.24 | 85,366,948.79 |
| 减：所得税费用 | 67,599,970.21 | 47,650,288.30 | 16,194,944.42 | 14,102,756.18 |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | 230,594,198.26 | 161,711,434.82 | 73,925,472.82 | 71,264,192.61 |
| 其中：归属于母公司所有者的净利润 | 230,594,198.26 | | 73,925,472.82 | |
| 少数股东损益 | | | | |
| 六、每股收益： | | | | |
| （一）基本每股收益 | 0.12 | | 0.04 | |
| （二）稀释每股收益 | 0.12 | | 0.04 | |
| 七、其他综合收益 | 66,112,018.13 | 65,414,562.87 | -117,276,316.46 | -118,780,769.71 |
| 八、综合收益合计 | 296,706,216.39 | 227,125,997.69 | -43,350,843.64 | -47,516,577.10 |
| 其中：归属于母公司所有者的综合收益总额 | 296,706,216.39 | | -43,350,843.64 | |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | | | |

法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

1.4 年初到报告期末现金流量表

编制单位：国元证券股份有限公司

2013 年 1-9 月

单位：（人民币）元

| 项目 | 2013 年 1-9 月 | | 2012 年 1-9 月 | |
|-----------------------|--------------|-----|--------------|-----|
| | 合并 | 母公司 | 合并 | 母公司 |
| 一、经营活动产生的现金流量： | | | | |
| 处置交易性金融资产净增加额 | | | | |

| | | | | |
|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 收取利息、手续费及佣金的现金 | 1,045,801,814.08 | 991,372,923.27 | 962,769,357.40 | 872,283,565.55 |
| 拆入资金净增加额 | -100,000,000.00 | -100,000,000.00 | | |
| 回购业务资金净增加额 | 175,614,015.98 | 203,316,085.98 | -547,200,799.58 | -547,200,799.58 |
| 代理买卖业务的现金净增加额 | -1,168,499,931.80 | -649,362,175.85 | -695,699,563.52 | -988,832,906.54 |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 268,911,946.25 | 181,676,814.01 | 17,984,573.13 | 17,663,315.11 |
| 经营活动现金流入小计 | 221,827,844.51 | 627,003,647.41 | -262,146,432.57 | -646,086,825.46 |
| 处置交易性金融资产净减少额 | 3,285,303,697.05 | 1,148,525,471.34 | 619,279,237.94 | 629,791,213.47 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | 118,339,281.81 | 106,195,152.70 | 38,010,714.80 | 32,639,581.53 |
| 融出资金净增加额 | 2,744,872,682.78 | 2,624,379,359.11 | 303,880,037.97 | 337,737,987.34 |
| 支付给职工以及为职工支付的现金 | 414,698,959.56 | 363,617,600.33 | 409,491,743.23 | 381,526,028.77 |
| 支付的各项税费 | 172,232,186.97 | 141,359,196.81 | 185,547,196.33 | 181,027,321.12 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 391,776,585.23 | 193,688,426.08 | 440,830,397.01 | 204,981,034.28 |
| 经营活动现金流出小计 | 7,127,223,393.40 | 4,577,765,206.37 | 1,997,039,327.28 | 1,767,703,166.51 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -6,905,395,548.89 | -3,950,761,558.96 | -2,259,185,759.85 | -2,413,789,991.97 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | | |
| 收回投资收到的现金 | 28,259,600.00 | | | |
| 取得投资收益收到的现金 | 55,887,610.10 | 52,625,721.00 | 86,579,721.00 | 85,525,721.00 |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | | |
| 投资活动现金流入小计 | 84,147,210.10 | 52,625,721.00 | 86,579,721.00 | 85,525,721.00 |
| 投资支付的现金 | 15,000,000.00 | 1,515,000,000.00 | 41,500,000.00 | |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | 111,254,415.65 | 108,037,860.21 | 124,040,253.20 | 121,460,287.79 |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | 154,101.51 | 99,985.70 | 316,592.98 | 311,066.68 |
| 投资活动现金流出小计 | 126,408,517.16 | 1,623,137,845.91 | 165,856,846.18 | 121,771,354.47 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -42,261,307.06 | -1,570,512,124.91 | -79,277,125.18 | -36,245,633.47 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | | |
| 发行债券收到的现金 | 4,974,000,000.00 | 4,974,000,000.00 | | |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | 4,974,000,000.00 | 4,974,000,000.00 | | |
| 偿还债务支付的现金 | | | | |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | 196,410,000.00 | 196,410,000.00 | 196,410,000.00 | 196,410,000.00 |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | 1,020,000.00 | 1,020,000.00 | | |
| 筹资活动现金流出小计 | 197,430,000.00 | 197,430,000.00 | 196,410,000.00 | 196,410,000.00 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 4,776,570,000.00 | 4,776,570,000.00 | -196,410,000.00 | -196,410,000.00 |

| | | | | |
|--------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | -12,701,670.02 | -188,335.52 | 6,859,269.21 | 41,294.19 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | -2,183,788,525.97 | -744,892,019.39 | -2,528,013,615.82 | -2,646,404,331.25 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | 11,067,435,054.59 | 8,443,825,977.06 | 14,167,883,129.00 | 12,400,992,393.22 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | 8,883,646,528.62 | 7,698,933,957.67 | 11,639,869,513.18 | 9,754,588,061.97 |

法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

二、审计报告

第三季度报告是否经过审计

是 否

公司第三季度报告未经审计。

国元证券股份有限公司

法定代表人：蔡咏

二〇一三年十月二十八日