



**申万宏源集团股份有限公司**  
**SHENWAN HONGYUAN GROUP CO., LTD.**

(证券代码：000166)

## **2015年第三季度报告**

二〇一五年十月二十七日

## §1 重要提示

1.1 本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本季度报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性负个别及连带责任。

1.2 没有董事、监事、高级管理人员声明对季度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

1.3 本季度报告经公司第四届董事会第十二次会议审议通过。会议应参会董事 9 人，实际参会董事 9 人。

1.4 公司本季度财务会计报表未经审计。

1.5 公司法定代表人、总经理陈亮先生，财务总监阳昌云先生，计划财务部总经理张延强先生声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

## §2 公司基本情况

### 2.1 主要会计数据及财务指标

单位：元

项目	本报告期末	上年度期末	本报告期末比上年度期末增减 (%)
总资产	349,709,689,873.54	202,311,557,755.42	72.86
归属于上市公司股东的所有者权益	46,439,496,203.95	31,689,072,324.19	46.55
归属于上市公司股东的每股净资产	3.13	2.73	14.65
项目	年初至报告期期末		比上年同期增减 (%)
经营活动产生的现金流量净额	53,108,545,343.27		159.23
每股经营活动产生的现金流量净额	3.57		102.44
项目	报告期	年初至报告期期末	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	4,611,480,780.09	21,664,934,784.32	144.58
归属于上市公司股东的净利润	1,038,705,033.34	8,394,784,057.91	157.55
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,016,053,768.46	8,365,553,359.91	334.32
加权平均净资产收益率%	2.26	19.96	增加 11.55 个百分点
扣除非经常性损益后的净资产收益率%	2.18	19.85	增加 11.23 个百分点
基本每股收益	0.07	0.57	137.50
稀释每股收益	0.07	0.57	137.50
非经常性损益项目	年初至报告期期末金额 (元)		
非流动资产处置损益	-7,870,489.21		
计入当期损益的政府补助	41,065,800.16		
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	8,963,307.59		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-1,535,348.67		
减：所得税影响额	8,800,879.09		

少数股东权益影响额（税后）	2,591,692.78
合计	29,230,698.00

注释：本公司在计算上年度期末归属于上市公司股东的每股净资产与比较期间每股收益时，已按照本次吸收合并中为获取原宏源证券同一控制下股东持有的股份所新发行的股份数额，重新计算调整了上年度期末与比较期间发行在外的加权平均普通股数。

## 2.2 报告期末股东总人数及前十名无限售条件股东持股情况表

单位：股

股东总数	357,771 位				
<b>前 10 名股东持股情况</b>					
股东名称	股东性质	持股比例	持股总数	持有非流通股数量	质押或冻结的股份数量
中国建银投资有限责任公司	国有法人	32.89	4,886,153,294	4,886,153,294	
中央汇金投资有限责任公司	国有法人	26.02	3,865,182,898	3,718,967,798	
上海久事公司	国有法人	6.05	898,378,066	898,378,066	
中国光大集团股份公司	国有法人	4.98	740,000,000	740,000,000	50,000,000
中国证券金融股份有限公司	境内一般法人	2.01	299,011,177	-	
华夏人寿保险股份有限公司 — 万能保险产品	其他	0.77	113,886,784	-	
新疆凯迪投资有限责任公司	国有法人	0.67	100,000,000	-	
赣州壹申投资合伙企业（有限合伙）	境内一般法人	0.67	100,000,000	100,000,000	
浙江中国小商品城集团股份有限公司	国有法人	0.63	92,909,139	92,909,139	
上海东方明珠（集团）股份有限公司	国有法人	0.42	62,600,000	62,600,000	
<b>前 10 名无限售条件股东持股情况</b>					
股东名称	持有流通股数量		股份种类		
中国证券金融股份有限公司	299,011,177		人民币普通股		
中央汇金投资有限责任公司	146,215,100		人民币普通股		
华夏人寿保险股份有限公司— 万能保险产品	113,886,784		人民币普通股		
新疆凯迪投资有限责任公司	100,000,000		人民币普通股		
汇达资产托管有限责任公司	29,555,389		人民币普通股		
中国农业银行股份有限公司— 易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金	26,630,097		人民币普通股		
中国工商银行股份有限公司— 申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金	25,551,396		人民币普通股		
东方证券股份有限公司转融通担保证券明细账户	21,818,300		人民币普通股		
国泰君安证券股份有限公司	21,271,861		人民币普通股		
新疆生产建设兵团投资有限责任公司	18,534,568		人民币普通股		

上述股东关联关系或一致行动的说明	中央汇金投资有限责任公司持有中国建银投资有限责任公司 100% 股权，持有中国光大集团股份公司 55.67% 股权。
参与融资融券业务股东情况说明（如有）	无

### §3 重要事项

#### 3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

√适用 □不适用

单位：元

项目	2015年9月30日	2014年12月31日	增减额	增减幅度(%)	变动原因
货币资金	157,430,786,231.11	79,702,169,318.24	77,728,616,912.87	97.52	客户交易资金增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	74,858,838,562.47	17,165,691,163.31	57,693,147,399.16	336.10	自营业务投资规模增加
买入返售金融资产	1,954,153,463.27	3,090,664,086.93	-1,136,510,623.66	-36.77	债券回购业务规模减少
应收款项	10,417,612,348.10	1,622,374,560.99	8,795,237,787.11	542.12	与证金公司签订收益互换协议
应收利息	1,508,355,181.66	850,579,473.79	657,775,707.87	77.33	应收融资融券利息增加
可供出售金融资产	22,344,521,040.16	16,106,158,422.01	6,238,362,618.15	38.73	自营业务投资规模增加
长期股权投资	618,700,675.50	420,931,855.81	197,768,819.69	46.98	对联营企业富国基金管理有限公司权益法确认部分增加
在建工程	97,098,795.85	70,213,896.83	26,884,899.02	38.29	新增装修工程
递延所得税资产	386,531,618.76	66,758,790.24	319,772,828.52	479.00	可抵扣暂时性差异增加
其他资产	1,809,469,757.85	2,834,268,049.02	-1,024,798,291.17	-36.16	应收款项类投资金额减少
短期借款	259,948,769.89	801,074,092.92	-541,125,323.03	-67.55	抵押借款减少
应付短期融资款	26,272,772,769.89	7,802,026,072.93	18,470,746,696.96	236.74	当期发行短期公司债、收益凭证
卖出回购金融资产款	73,879,298,689.81	38,160,161,781.98	35,719,136,907.83	93.60	信用业务收益权转让规模增加
代理买卖证券款	132,490,809,149.52	80,001,175,779.48	52,489,633,370.04	65.61	经纪客户交易结算资金增加
应付职工薪酬	4,919,677,911.57	1,303,434,101.89	3,616,243,809.68	277.44	计提的职工薪酬增加
应交税费	2,403,577,555.75	1,277,058,821.56	1,126,518,734.19	88.21	当期应交企业所得税增加
应付款项	604,409,397.27	187,793,128.31	416,616,268.96	221.85	应付清算款增加
应付利息	1,897,188,480.97	475,865,903.22	1,421,322,577.75	298.68	应付债券利息增加
应付债券	32,813,053,093.15	15,971,719,969.14	16,841,333,124.01	105.44	当期发行次级债券
其他负债	19,072,430,422.11	7,608,475,366.21	11,463,955,055.90	150.67	合并结构化主体增加
股本	14,856,744,977.00	6,715,760,000.00	8,140,984,977.00	121.22	发行新股换股吸收合并宏源证券
其他综合收益	-502,409,963.31	653,288,839.54	-1,155,698,802.85	-176.90	可供出售金融资产公允价值变动
未分配利润	19,915,328,231.08	10,643,434,315.59	9,271,893,915.49	87.11	本期净利润增加

项目	2015 年 1-9 月	2014 年 1-9 月	增减额	增减幅度(%)	变动原因
手续费及佣金净收入	15,242,327,542.96	5,220,535,958.69	10,021,791,584.27	191.97	经纪业务手续费净收入增加
投资收益	4,909,931,028.61	1,413,861,187.88	3,496,069,840.73	247.27	自营业务投资收益增加
公允价值变动收益	-208,819,062.90	539,978,058.84	-748,797,121.74	-138.67	交易性金融资产公允价值下降
营业税金及附加	1,441,733,511.15	470,756,927.35	970,976,583.80	206.26	营业收入增长
业务及管理费	8,427,526,739.63	4,089,639,129.05	4,337,887,610.58	106.07	职工薪酬增加
资产减值损失	-9,500,307.59	-72,492,810.98	62,992,503.39	86.89	坏账准备净转回减少
其他业务成本	54,332,118.78	125,037,354.44	-70,705,235.66	-56.55	期货现货套利中现货成本减少
所得税费用	3,147,186,955.49	968,544,889.27	2,178,642,066.22	224.94	利润总额增加,相应应纳税所得额增加
其他综合收益的税后净额	-1,225,804,472.04	369,860,274.92	-1,595,664,746.96	-431.42	可供出售金融资产公允价值变动

### 3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√适用 □不适用

(一) 为了进一步支持公司业务的发展,充实资本实力,应对证券行业发展及行业竞争,实现稳健经营,提高风险抵御能力,促进公司更好更快地发展,为全体股东带来更丰厚的回报,公司拟向特定对象非公开发行 A 股股票(以下简称“非公开发行”)。相关议案已经公司董事会审议同意。本次非公开发行 A 股股票的数量不超过 110,000 万股(含 110,000 万股),发行价格不低于 12.3 元,募集资金总额不超过人民币 140 亿元。详细情况请见公司 2015 年 6 月 13 日、8 月 13 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)的《公司第四届董事会第六次会议决议公告》、《公司第四届董事会第十次会议决议公告》。

2015 年 8 月 28 日,公司 2015 年第二次临时股东大会审议通过了公司本次非公开发行事项的各项议案。详细情况请见公司 2015 年 8 月 29 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)的《公司 2015 年第二次临时股东大会决议公告》。

2015 年 9 月 7 日,公司收到中国证监会出具的《中国证监会行政许可申请受理通知书》(152656 号),中国证监会决定对该行政许可申请予以受理。详细情况请见公司 2015 年 9 月 9 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)的《关于中国证监会受理公司非公开发行股票申请的公告》。

2015 年 10 月 13 日,公司收到中国证监会出具的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》(152656 号)。详细情况请见公司 2015 年 10 月 14 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)的《关于收到非公开发行股票反馈意见的公告》。

公司本次非公开发行股票事项尚需中国证监会的核准。

(二) 2015 年 7 月 4 日,本公司所属子公司申万宏源证券有限公司(以下简称“申万宏源证券”)与其他 20 家证券公司召开会议,一致表示坚决维护股票市场稳定发展,并发布《21 家证券公司联合公告》。根据公告,21 家证券公司以 2015 年 6 月底净资产 15% 出资,合计不低于 1,200 亿元,用于投资蓝筹股 ETF。2015 年 7 月 6 日,申万宏源证券召开第一届董事会第七次会议,审议通过了《关于公司有关的投资事项的议案》,并于当日将人民币 63.90 亿元出资资金汇入中国证券金融股份有限公司指定账户。

2015 年 9 月 2 日,公司收到公司所属子公司申万宏源证券报告,申万宏源证券与中国证券金融

股份有限公司签订《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议》及《收益互换交易确认书》，约定以申万宏源证券2015年7月底净资产20%出资，用于投资蓝筹股等。申万宏源证券在扣除已于2015年7月6日按2015年6月底净资产15%，即63.90亿元的出资后，补充出资21.6416亿元，并已完成相关资金的划付。本次出资由中国证券金融股份有限公司设立专户进行统一运作，由50家证券公司按缴资比例分担投资风险、分享投资收益。详细情况请见公司2015年7月8日、2015年9月7日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（<http://www.cninfo.com.cn>）的《关于申万宏源证券有限公司投资事项的公告》、《关于申万宏源证券有限公司追加出资投资于蓝筹股等事项的公告》。

（三）2015年8月18日，公司收到公司股东中央汇金投资有限责任公司（以下简称“中央汇金”）来函，中央汇金通过协议转让方式受让了公司A股股份146,215,100股。受让后，中央汇金直接持有公司A股股份3,865,182,898股，约占公司总股本的26.02%。详细情况请见2015年8月20日公司刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（<http://www.cninfo.com.cn>）的《关于中央汇金投资有限责任公司持股变动的公告》。

### 3.3 公司及持股 5%以上的股东承诺事项履行情况

√适用    □不适用

（一）申银万国证券股份有限公司以换股方式吸收合并宏源证券股份有限公司相关承诺情况：

1. 中央汇金投资有限责任公司未履行完毕承诺情况：

（1）《关于避免同业竞争的承诺函》

此项承诺于2014年7月22日作出，正在履行中。

（2）《关于业务、资产、人员、财务和机构“五分开”的承诺函》

此项承诺于2014年7月22日作出，正在履行中。

（3）《关于持有申银万国证券股份有限公司股份锁定期的承诺》

此项承诺于2014年6月24日作出，正在履行中。

2. 中国建银投资有限责任公司未履行完毕承诺情况：

（1）《关于避免同业竞争的承诺函》

此项承诺于2014年7月18日作出，正在履行中。

（2）《关于业务、资产、人员、财务和机构“五分开”的承诺函》

此项承诺于2014年7月18日作出，正在履行中。

（3）《关于减少和规范关联交易的承诺函》

此项承诺于2014年7月18日作出，正在履行中。

（4）《关于持有申银万国证券股份有限公司股份锁定期的承诺》

此项承诺于2014年10月17日作出，正在履行中。

3. 股东上海久事公司承诺如下：

自发行人股票上市12个月内，不转让或者委托他人管理本单位已直接和间接持有的发行人公开发行股票前已发行的股份，也不由发行人回购该部分股份。

此项承诺于2014年6月20日作出，正在履行中。

以上承诺事项详见2015年4月30日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（<http://www.cninfo.com.cn>）的《申万宏源集团股份有限公司2014年年度报告》“第五节重要事项”之“六、公司及持股5%以上股东在报告期内及持续到报告期内的承诺事项”。

（二）申银万国证券换股吸收合并宏源证券股份有限公司后相关承诺情况及股份限售情

况:

申万宏源集团股份有限公司控股股东中国建银投资有限责任公司、实际控制人中央汇金投资有限责任公司及本次发行前的其他股东已按照相关法律、法规的规定，承诺在一定的期间内不转让或者委托他人管理其直接和间接持有的申万宏源的股份，也不由申万宏源回购该部分股份。各股东承诺及股份限售情况详见2015年1月22日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（<http://www.cninfo.com.cn>）的《申万宏源集团股份有限公司换股吸收合并宏源证券股份有限公司上市公告书》“第二节股票上市情况”之“二、公司股票上市概况”

### 3.4 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

目前，申万宏源集团股份有限公司通过所属子公司申万宏源证券有限公司及其下属申万宏源西部证券有限公司和申万宏源证券承销保荐有限责任公司开展证券业务。由于证券业务受市场影响较大，因此无法对公司下一报告期业绩进行准确预测。公司将在下一报告期结束后，及时进行披露。

### 3.5 其他需说明的重大事项

#### 3.5.1 证券投资情况

适用 不适用

单位：元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	期末持股数量（股）	期末账面值	占期末证券总投资比例（%）	报告期损益
次级债券	-	证金72次级债	8,000,000,000.00	80,000,000.00	8,000,000,000.00	8.69	0
货币基金	000693	建信现金添利	7,207,432,368.36	7,251,305,279.80	7,251,305,279.80	7.88	43,872,911.44
货币基金	460106	华泰柏瑞货币	3,821,519,340.17	3,825,004,535.33	3,825,004,535.33	4.16	3,485,195.16
货币基金	202302	南方现金增利	2,008,631,674.52	2,009,431,409.69	2,009,431,409.69	2.18	724,272.03
货币基金	000506	国寿安保货币	1,951,149,417.46	1,956,638,741.10	1,956,638,741.10	2.13	5,489,323.64
资管计划	DZ0001	国联证券汇盈7号定向资产管理	1,870,000,000.00	1,870,000,000.00	1,870,000,000.00	2.03	0
货币基金	000908	农银汇理红利日结	1,602,509,117.32	1,605,552,743.79	1,605,552,743.79	1.74	3,43,626.47
货币基金	001374	华夏现金增利B	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	1.63	0
货币基金	202308	南方收益宝	1,203,481,877.86	1,206,618,865.72	1,206,618,865.72	1.31	3,136,987.86
理财产品	F150815	宁波银行理财产品	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	1.09	
期末持有的其他证券投资			61,247,724,730.99	14,201,208,387.13	61,799,896,173.11	67.16	-268,571,379.50
报告期已出售证券投资损益							4,598,042,516.08
合计			91,412,448,526.68	36,505,759,962.56	92,024,447,748.54	100	4,389,223,453.18

#### 3.5.2 持有其他上市公司股权情况

适用 不适用

单位：元

证券代码	证券简称	初始投资金额	持股数量(股)		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
			期初	期末	期初	期末					
601211	国泰君安	1,487,477,384.24	0	53,500,000	0.00	0.70	995,100,000.00	104,565.24	-369,283,038.18	可供出售金融资产	购买
600030	中信证券	1,258,532,392.45	0	55,929,927	0.00	0.46	759,528,408.66	-	-374,252,987.84	可供出售金融资产	购买
600649	城投控股	98,516,443.52	53,998,466	53,998,466	1.81	1.81	690,640,380.14	-	225,173,603.22	可供出售金融资产	购买
600837	海通证券	874,876,509.73	0	48,300,000	0.00	0.42	615,825,000.00	631,821.77	-194,288,632.30	可供出售金融资产	购买
600958	东方证券	292,392,460.90	0	11,900,000	0.00	0.23	194,803,000.00	2,611,672.11	-73,192,095.68	可供出售金融资产	购买
002671	龙泉股份	66,448,189.80		7,881,289	0.00	1.78	188,283,994.21	551,690.23	75,464,868.36	可供出售金融资产	购买
601231	环旭电子	211,847,977.44	7,828,824	15,657,648	0.72	0.72	179,593,222.56	-	-24,191,066.16	可供出售金融资产	购买
600000	浦发银行	178,211,696.23	0	10,000,000	0.00	0.05	166,300,000.00	-	-8,933,772.17	可供出售金融资产	购买
002326	永太科技	65,531,994.84	4,345,623	12,167,744	1.52	1.52	142,119,249.92	-	57,440,441.31	可供出售金融资产	购买
601169	北京银行	173,784,487.41	0	15,600,000	0.00	0.12	134,316,000.00	-	-29,601,365.56	可供出售金融资产	购买
其他		1,586,746,403.15	68,482,316.00	216,731,052.00			1,228,625,419.79	307,988,763.18	-143,020,612.39		
合计:		6,294,365,939.71	134,655,229.00	501,666,126.00			5,295,134,675.28	311,888,512.53	-858,684,657.38		

### 3.5.3 持有非上市金融企业、拟上市公司股权情况

√适用 □不适用

单位：元

所持对象名称	初始投资金额	持有数量	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
申万宏源证券有限责任公司	36,855,001,008.84	33,000,000,000.00	100	36,855,001,008.84	-	45,935,816,537.29	长期股权投资	出资
申万宏源西部证券有限公司	1,200,000,000.00	1,200,000,000.00	100	1,200,000,000.00	-	2,122,083,956.77	长期股权投资	出资
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	100	1,000,000,000.00	-	1,144,559,732.66	长期股权投资	出资
富国基金管理有限公司	49,995,000.00	49,995,000.00	28	721,574,394.45	245,142,562.79	568,151,246.15	长期股权投资	出资
申万宏源(国际)集团有限公司	574,405,636.25	642,166,220.00	100	574,405,636.25	-	258,797,900.80	长期股权投资	出资
申万菱信基金管理有限公司	100,500,000.00	100,500,000.00	67	100,500,000.00	-	274,111,761.39	长期股权投资	出资
申银万国期货有限公司	770,385,582.48	746,639,000.00	96	770,385,582.48	-	70,968,571.89	长期股权投资	企业合并
宏源期货有限公司	563,169,463.67	550,000,000.00	100	563,169,463.67	-	56,294,190.10	长期股权投资	企业合并
合计	41,113,456,691.24	37,289,300,220.00		41,587,267,266.00	245,142,562.79	50,430,783,897.05		

**3.5.4 公司是否存在向控股股东或其关联方提供资金、违反规定程序对外提供担保的情况。**

适用 不适用

**3.5.5 报告期接待调研、沟通、采访等活动情况**

适用 不适用

**3.6 衍生品投资情况**

适用 不适用

报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明	公司所属子公司具有开展相关业务的资格。衍生产品自营业务目前主要涉及股指期货及国债期货套利、套期保值、投机等自营业务和券商OTC柜台业务。报告期内公司所属子公司进行衍生产品投资业务时完全按照中国证监会、中国证券业协会及中金所的要求，规范运作，风险可控，不存在违法、违规操作。为保证衍生品自营业务规范运作，防范业务风险，公司以相关业务管理办法等规章制度为准则，依照业务方案，在分析及控制市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等情况下开展此项业务。
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	公司持有的用于非套期的未到期股指期货合约的公允价值净浮亏人民币 2,948,160.00 元；持有的用于非套期的未到期国债期货合约的公允价值净浮亏人民币 7,763,400.00 元；持有的用于非套期的未到期商品期货合约的公允价值净浮亏人民币 10,151,399.00 元。
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	衍生品政策不变，从市场直接获取报价。
独立董事对公司衍生品投资及风险控制情况的专项意见	公司所属子公司已获得相关业务资格，可以开展相关业务。截至报告期末，利率衍生工具持仓合约价值 911,000,000.00 元，占公司报告期末净资产 1.96%；权益衍生工具持仓合约价值 164,408,787.00 元，占公司报告期末净资产的 0.35%；其他衍生工具持仓合约价值 161,245,789.88 元，占公司报告期末净资产 0.35%。风险可控。同时，符合监管部门相关监管指标要求。此项业务不存在损害公司和全体股东权益的情况。

**3.6.1 报告期末衍生品投资的持仓情况**

适用 不适用

单位：元

合约种类	合约到期期限	期初合约金额	期末合约金额	期末合约金额占公司报告期末净资产比例
------	--------	--------	--------	--------------------

利率衍生工具	2015/12-2016/03	50,000,000.00	911,000,000.00	1.96%
权益衍生工具	2015/10-2015/12	516,158,707.76	164,408,787.00	0.35%
其他衍生工具	2015/12-2016/05	87,918,200.90	161,245,789.88	0.35%
合计	-	654,076,908.66	1,236,654,576.88	2.66%

董事长：储晓明

申万宏源集团股份有限公司董事会

二〇一五年十月二十七日

## 附录：

## 资产负债表

编制单位：申万宏源集团股份有限公司

金额单位：人民币元

资产	合并		母公司	
	2015年9月30日	2014年12月31日	2015年9月30日	2014年12月31日
资产：				
货币资金	157,430,786,231.11	79,702,169,318.24	20,728,475.13	48,722,406,393.75
其中：客户存款	112,144,641,692.99	63,320,206,685.38	-	40,582,550,712.49
结算备付金	18,621,992,650.08	14,811,683,466.44	-	10,443,214,399.49
其中：客户备付金	17,615,424,860.28	13,143,539,377.68	-	9,981,681,839.67
拆出资金	-	-	-	-
融出资金	51,803,094,791.53	58,999,024,864.41	-	42,478,360,769.72
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	74,858,838,562.47	17,165,691,163.31	-	4,807,984,717.93
衍生金融资产	22,166,489.00	1,078,372.17	-	1,078,372.17
买入返售金融资产	1,954,153,463.27	3,090,664,086.93	-	784,190,481.86
应收款项	10,417,612,348.10	1,622,374,560.99	-	855,180,613.00
应收利息	1,508,355,181.66	850,579,473.79	-	341,732,038.52
存出保证金	6,199,960,997.81	4,838,299,220.22	-	249,095,046.61
可供出售金融资产	22,344,521,040.16	16,106,158,422.01	73,112,996.01	7,004,045,605.58
持有至到期投资	116,222,821.19	120,000,000.00	-	-
长期股权投资	618,700,675.50	420,931,855.81	36,855,001,008.84	3,384,223,074.54
投资性房地产	96,883,049.58	100,287,158.86	24,462,624.53	-
固定资产	1,251,868,309.30	1,330,579,951.71	595,615,361.99	446,043,086.57
在建工程	97,098,795.85	70,213,896.83	-	68,550,424.83
无形资产	108,718,578.93	119,756,176.35	-	42,148,279.78
商誉	62,714,511.39	61,038,928.09	-	-
递延所得税资产	386,531,618.76	66,758,790.24	4,442,321.25	-
其他资产	1,809,469,757.85	2,834,268,049.02	21,636,428.34	175,811,233.65
资产总计	349,709,689,873.54	202,311,557,755.42	37,594,999,216.09	119,804,064,538.00
法定代表人：陈亮	主管会计工作负责人：阳昌云	会计机构负责人：张延强		

## 资产负债表 (续)

编制单位: 申万宏源集团股份有限公司

金额单位: 人民币元

负债和股东权益	合并		母公司	
	2015年9月30日	2014年12月31日	2015年9月30日	2014年12月31日
负债:				
短期借款	259,948,769.89	801,074,092.92		
应付短期融资款	26,272,772,769.89	7,802,026,072.93		7,802,026,072.93
拆入资金	6,439,000,000.00	9,008,000,000.00		3,669,000,000.00
交易性金融负债	486,124,500.00			
衍生金融负债	55,491,356.84	13,808.22		
卖出回购金融资产款	73,879,298,689.81	38,160,161,781.98		18,728,615,520.14
代理买卖证券款	132,490,809,149.52	80,001,175,779.48		50,730,907,458.89
代理承销证券款	-			
应付职工薪酬	4,919,677,911.57	1,303,434,101.89	218,347.24	568,125,085.85
应交税费	2,403,577,555.75	1,277,058,821.56	122,684,656.08	628,351,545.74
应付款项	604,409,397.27	187,793,128.31		170,985,557.18
应付利息	1,897,188,480.97	475,865,903.22		353,333,246.11
长期借款	-			
应付债券	32,813,053,093.15	15,971,719,969.14		15,971,719,969.14
递延所得税负债	110,439,102.95	118,370,213.95	-	118,343,780.49
其他负债	19,072,430,422.11	7,608,475,366.21	116,386,589.37	332,801,929.06
负债合计	301,704,221,199.72	162,715,169,039.81	239,289,592.69	99,074,210,165.53
股东权益:				
股本	14,856,744,977.00	6,715,760,000.00	14,856,744,977.00	6,715,760,000.00
资本公积	4,453,808,776.71	5,997,379,237.82	9,210,267,508.25	
减: 库存股	-		-	
其他综合收益	-502,409,963.31	653,288,839.54	5,758,626.85	518,273,244.37
盈余公积	2,540,057,698.50	2,540,057,698.50	1,949,586,096.07	1,949,586,096.07
一般风险准备	5,175,966,483.97	5,139,152,232.74	3,849,860,528.88	3,849,860,528.88
未分配利润	19,915,328,231.08	10,643,434,315.59	7,483,491,886.35	7,696,374,503.15
归属于母公司股东权益合计	46,439,496,203.95	31,689,072,324.19	37,355,709,623.40	20,729,854,372.47
少数股东权益	1,565,972,469.87	7,907,316,391.42		
股东权益合计	48,005,468,673.82	39,596,388,715.61	37,355,709,623.40	20,729,854,372.47
负债和股东权益总计	349,709,689,873.54	202,311,557,755.42	37,594,999,216.09	119,804,064,538.00

法定代表人: 陈亮

主管会计工作负责人: 阳昌云

会计机构负责人:

张延强

### 利润表

编制单位：申万宏源集团股份有限公司

金额单位：人民币元

项 目	合 并		母 公 司	
	2015年1-9月	2014年1-9月	2015年1-9月	2014年1-9月
一、营业收入	21,664,934,784.32	8,857,862,244.80	106,558,526.34	4,501,393,975.20
手续费及佣金净收入	15,242,327,542.96	5,220,535,958.69	-	2,919,585,016.75
其中：经纪业务手续费净收入	12,353,754,616.96	3,463,915,319.03	-	2,220,232,898.32
投资银行业务手续费净收入	935,528,650.42	782,920,620.89	-	294,168,519.51
资产管理业务及基金管理业务手续费净收入	1,298,727,704.38	723,829,510.77	-	405,183,598.92
利息净收入	1,607,792,982.06	1,523,452,202.26	53,208.67	1,040,229,779.97
投资收益（损失以“-”号填列）	4,909,931,028.61	1,413,861,187.88	105,911,827.67	411,915,183.71
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	245,142,562.79	66,404,006.35	-	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-208,819,062.90	539,978,058.84	-	123,108,336.76
汇兑收益（损失以“-”号填列）	4,897,435.56	-349,014.23	-	352,194.30
其他业务收入	108,804,858.03	160,383,851.36	593,490.00	6,203,463.71
二、营业支出	9,914,092,061.97	4,612,940,599.86	53,406,211.80	2,170,327,957.59
营业税金及附加	1,441,733,511.15	470,756,927.35	33,235.45	261,369,694.97
业务及管理费	8,427,526,739.63	4,089,639,129.05	53,238,766.23	1,981,007,926.66
资产减值损失	-9,500,307.59	-72,492,810.98	-537,000.00	-74,840,204.23
其他业务成本	54,332,118.78	125,037,354.44	671,210.12	2,790,540.19
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	11,750,842,722.35	4,244,921,644.94	53,152,314.54	2,331,066,017.61
加：营业外收入	44,050,961.90	32,873,911.52	-	1,665,726.42
减：营业外支出	12,390,999.63	3,526,152.32	7,438,182.00	2,141,277.53
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,782,502,684.62	4,274,269,404.14	45,714,132.54	2,330,590,466.50
减：所得税费用	3,147,186,955.49	968,544,889.27	258,596,749.34	500,350,697.31
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,635,315,729.13	3,305,724,514.87	-212,882,616.80	1,830,239,769.19
归属于母公司股东的净利润	8,394,784,057.91	3,259,530,970.01	-212,882,616.80	1,830,239,769.19
少数股东损益	240,531,671.22	46,193,544.86	-	-
六、每股收益：				
（一）基本每股收益	0.57	0.24		
（二）稀释每股收益	0.57	0.24		
七、其他综合收益	-1,225,804,472.04	369,860,274.92	5,758,626.85	208,271,686.24
八、综合收益总额	7,409,511,257.09	3,675,584,789.79	-207,123,989.95	2,038,511,455.43
归属于母公司股东的综合收益总额	7,210,536,240.99	3,614,956,832.61	-207,123,989.95	2,038,511,455.43
归属于少数股东的综合收益总额	198,975,016.10	60,627,957.18	-	-

法定代表人：陈亮

主管会计工作负责人： 阳昌云

会计机构负责人：

张延强

## 利润表(续)

编制单位: 申万宏源集团股份有限公司

金额单位: 人民币元

项 目	合 并		母 公 司	
	2015年7-9月	2014年7-9月	2015年7-9月	2014年7-9月
一、营业收入	4,611,480,780.09	3,567,800,050.63	778,836.99	1,820,116,617.21
手续费及佣金净收入	4,332,362,937.25	2,138,109,153.56	-	1,278,111,285.86
其中: 经纪业务手续费净收入	3,207,139,321.76	1,549,397,983.47	-	1,010,111,294.23
投资银行业务手续费净收入	317,594,960.51	163,880,578.12	-	140,107,938.35
资产管理业务及基金管理业务手续费净收入	234,767,895.97	335,117,895.44	-	127,892,053.28
利息净收入	-331,290,602.39	555,001,282.97	22,844.89	398,906,839.03
投资收益(损失以“-”号填列)	1,409,111,765.53	578,736,661.72	558,162.10	103,473,833.97
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益	105,746,357.23	24,149,414.77	-	-42,254,591.58
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-835,259,950.53	238,406,779.73	-	37,860,050.82
汇兑收益(损失以“-”号填列)	1,488,768.79	1,606,194.38	-	352,693.49
其他业务收入	35,067,861.44	55,939,978.27	197,830.00	1,411,914.04
二、营业支出	2,945,233,739.13	1,749,547,064.94	21,195,238.69	809,186,217.94
营业税金及附加	434,168,500.42	187,987,445.56	11,078.49	106,844,912.38
业务及管理费	2,492,374,355.57	1,513,618,259.55	20,945,089.54	702,053,141.86
资产减值损失	3,700,603.62	-231,552.23	-	-231,552.23
其他业务成本	14,990,279.52	48,172,912.06	239,070.66	519,715.93
三、营业利润(亏损以“-”号填列)	1,666,247,040.96	1,818,252,985.69	-20,416,401.70	1,010,930,399.27
加: 营业外收入	30,130,625.99	14,393,657.97	-	765,671.11
减: 营业外支出	3,314,829.65	518,381.88	150,000.00	331,839.81
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,693,062,837.30	1,832,128,261.78	-20,566,401.70	1,011,364,230.57
减: 所得税费用	573,220,687.50	446,063,603.14	-	264,577,379.12
五、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,119,842,149.80	1,386,064,658.64	-20,566,401.70	746,786,851.45
归属于母公司股东的净利润	1,038,705,033.34	1,657,792,598.37	-20,566,401.70	746,786,851.45
少数股东损益	81,137,116.46	-271,727,939.73	-	-
六、每股收益:	-	-	-	-
(一) 基本每股收益	0.07	0.14	-	-
(二) 稀释每股收益	0.07	0.14	-	-
七、其他综合收益	-1,615,730,285.29	396,832,493.47	84,496,962.70	199,066,946.36
八、综合收益总额	-495,888,135.49	1,782,897,152.11	63,930,561.00	945,853,797.81
归属于母公司股东的综合收益总额	-536,806,573.64	2,030,169,874.68	63,930,561.00	945,853,797.81
归属于少数股东的综合收益总额	40,918,438.15	-247,272,722.57	-	-

法定代表人: 陈亮

主管会计工作负责人: 阳昌云

会计机构负责人: 张延强

## 现金流量表

编制单位：申万宏源集团股份有限公司

金额单位：人民币元

项 目	合并		母公司	
	2015年1-9月	2014年1-9月	2015年1-9月	2014年1-9月
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	-60,597,657,575.61	632,324,191.36	-	4,515,775,511.55
收取利息、手续费及佣金的现金	24,127,647,939.52	8,714,480,610.86	53,208.67	5,038,305,427.74
拆入资金净增加额	-2,569,000,000.00	672,171,400.00	-	668,950,411.55
回购业务资金净增加额	35,228,995,863.27	14,875,741,280.77	-	6,775,381,919.00
融出资金净减少额	7,313,220,012.72	-	-	-
代理买卖证券收到的现金净额	54,522,511,569.08	17,870,953,449.45	-	14,544,767,544.86
收到其他与经营活动有关的现金	13,323,694,763.46	1,049,163,605.72	836,766.12	10,449,987,663.32
经营活动现金流入小计	71,349,412,572.44	43,814,834,538.16	889,974.79	41,993,168,478.02
融出资金净增加额	-	13,938,566,222.86	-	10,293,101,101.08
代理买卖证券支付的现金净额	-	-	-	-
支付利息、手续费及佣金的现金	4,453,649,861.17	1,521,484,436.74	-	557,312,471.07
支付给职工以及为职工支付的现金	3,571,227,776.45	2,829,008,505.21	5,676,056.61	1,256,440,145.75
支付的各项税费	3,287,146,257.83	1,292,847,945.05	3,022,365.16	802,001,292.45
支付其他与经营活动有关的现金	6,928,843,333.72	3,746,103,014.65	13,440,109.69	15,638,568,374.66
经营活动现金流出小计	18,240,867,229.17	23,328,010,124.51	22,138,531.46	28,547,423,385.01
经营活动产生的现金流量净额	53,108,545,343.27	20,486,824,413.65	-21,248,556.67	13,445,745,093.01
二、投资活动产生的现金流量：				
收回投资收到的现金	109,984,447.80	2,868,957,971.57	109,984,447.80	1,848,721,143.81
取得投资收益收到的现金	1,552,823,694.46	343,913,259.72	-	129,727,252.88
吸收合并宏源证券所取得的现金	-	-	22,072,060,667.61	-
收到其他与投资活动有关的现金	1,692,336,052.47	17,272,243.87	-	-
投资活动现金流入小计	3,355,144,194.73	3,230,143,475.16	22,182,045,115.41	1,978,448,396.69
投资支付的现金	8,672,852,494.53	1,614,260,000.00	68,000,000.00	773,648,052.96
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	99,793,107.90	153,838,964.37	7,416.00	57,188,373.22
出资设立子公司支付的现金	-	-	81,168,107,540.85	-
支付其他与投资活动有关的现金	-	4,697,961,858.93	-	3,845,058.36
投资活动现金流出小计	8,772,645,602.43	6,466,060,823.30	81,236,114,956.85	834,681,484.54
投资活动产生的现金流量净额	-5,417,501,407.70	-3,235,917,348.14	-59,054,069,841.44	1,143,766,912.15

(所附注释系财务报表的组成部分)

法定代表人：陈亮

主管会计工作负责人：阳昌云

会计机构负责人：张延强

## 现金流量表（续）

编制单位：申万宏源集团股份有限公司

项 目	合 并		母 公 司	
	2015年1-9月	2014年1-9月	2015年1-9月	2014年1-9月
三、筹资活动产生的现金流量：				
吸收投资收到的现金	-	1,000,000.00	-	-
取得借款收到的现金	848,468,318.95	-	-	-
发行债券收到的现金	44,654,885,000.00	17,600,000,000.00	-	17,600,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	-	-17,517,425.20	-	-
筹资活动现金流入小计	45,503,353,318.95	17,583,482,574.80	-	17,600,000,000.00
偿还债务支付的现金	9,798,320,249.59	15,700,000,000.00	-	15,700,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	455,470,347.14	1,641,765,876.30	-	1,226,671,097.10
支付其他与筹资活动有关的现金	69,872,576.53	6,225,405.18	-	2,000,000.00
筹资活动现金流出小计	10,323,663,173.26	17,347,991,281.48	-	16,928,671,097.10
筹资活动产生的现金流量净额	35,179,690,145.69	235,491,293.32	-	671,328,902.90
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	286,497,523.12	1,731,949.79		351,760.20
五、现金及现金等价物净增加额	83,157,231,604.38	17,488,130,308.62	-59,075,318,398.11	15,261,192,668.26
加：期初现金及现金等价物余额	93,026,756,969.44	47,137,027,413.77	59,096,046,873.24	27,054,478,852.16
六、期末现金及现金等价物余额	176,183,988,573.82	64,625,157,722.39	20,728,475.13	42,315,671,520.42

（所附注释系财务报表的组成部分）

法定代表人：陈亮

主管会计工作负责人：阳昌云

会计机构负责人：张延强