

国元证券股份有限公司

2017年半年度报告

(国元证券 000728)



二〇一七年八月

## 第一节 重要提示、目录和释义

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半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。

所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。没有董事、监事、高级管理人员声明对本报告内容的真实性、准确性和完整性无法保证或存在异议。

公司计划不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。本公司2017年半年度财务会计报告未经会计师事务所审计。

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：保证本半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本报告中所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描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。

公司经营活动面临的具体风险有合规与政策风险、市场风险、信用风险、流动性风险、操作与管理风险、信息技术风险、创新与行业竞争风险等，公司在本报告“第四节经营情况讨论与分析”中具体分析了公司可能面对的风险以及公司根据实际情况已经或将要采取的措施，敬请投资者查阅。

## 目录

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 第一节 重要提示、目录和释义.....     | 1   |
| 第二节 公司简介和主要财务指标.....    | 4   |
| 第三节 公司业务概要.....         | 9   |
| 第四节 经营情况讨论与分析.....      | 11  |
| 第五节 重要事项.....           | 35  |
| 第六节 股份变动及股东情况.....      | 49  |
| 第七节 优先股相关情况.....        | 53  |
| 第八节 董事、监事、高级管理人员情况..... | 54  |
| 第九节 公司债相关情况.....        | 55  |
| 第十节 财务报告.....           | 65  |
| 第十一节 备查文件目录.....        | 198 |

## 释义

| 释义项     | 指 | 释义内容              |
|---------|---|-------------------|
| 公司、本公司  | 指 | 国元证券股份有限公司        |
| 国元集团    | 指 | 安徽国元控股（集团）有限责任公司  |
| 国元信托    | 指 | 安徽国元信托有限责任公司      |
| 安徽粮油    | 指 | 安徽省粮油食品进出口（集团）公司  |
| 长盛基金    | 指 | 长盛基金管理有限公司        |
| 国元香港    | 指 | 国元证券（香港）有限公司      |
| 国元直投    | 指 | 国元股权投资有限公司        |
| 国元期货    | 指 | 国元期货有限公司          |
| 国元创新    | 指 | 国元创新投资有限公司        |
| 安徽省股交中心 | 指 | 安徽省股权托管交易中心有限责任公司 |
| 安元基金    | 指 | 安徽安元投资基金有限公司      |
| 安元基金管理  | 指 | 安徽安元投资基金管理有限公司    |
| 中国证监会   | 指 | 中国证券监督管理委员会       |
| 上交所     | 指 | 上海证券交易所           |
| 深交所     | 指 | 深圳证券交易所           |
| 元、万元、亿元 | 指 | 人民币元、人民币万元、人民币亿元  |

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司简介

|               |                                    |      |        |
|---------------|------------------------------------|------|--------|
| 股票简称          | 国元证券                               | 股票代码 | 000728 |
| 变更后的股票简称(如有)  | 不适用                                |      |        |
| 股票上市证券交易所     | 深圳证券交易所                            |      |        |
| 公司的中文名称       | 国元证券股份有限公司                         |      |        |
| 公司的中文简称(如有)   | 国元证券                               |      |        |
| 公司的外文名称(如有)   | GUOYUAN SECURITIES COMPANY LIMITED |      |        |
| 公司的外文名称缩写(如有) | GUOYUAN SECURITIES                 |      |        |
| 公司法定代表人       | 蔡咏                                 |      |        |

### 二、联系人和联系方式

|      | 董事会秘书                      | 证券事务代表 |
|------|----------------------------|--------|
| 姓名   | 刘锦峰                        | —      |
| 联系地址 | 安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券 | —      |
| 电话   | 0551-62207968              | —      |
| 传真   | 0551-62207322              | —      |
| 电子信箱 | ljf2100@gyzq.com.cn        | —      |

### 三、其他情况

#### 1、公司联系方式

公司注册地址，公司办公地址及其邮政编码，公司网址、电子信箱在报告期是否变化

适用  不适用

公司注册地址，公司办公地址及其邮政编码，公司网址、电子信箱报告期无变化，具体可参见2016年年报。

#### 2、信息披露及备置地点

信息披露及备置地点在报告期是否变化

√ 适用 □ 不适用

|                     |                               |
|---------------------|-------------------------------|
| 公司选定的信息披露媒体的名称      | 《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》 |
| 登载年度报告的中国证监会指定网站网址  | http://www.cninfo.com.cn      |
| 公司年度报告备置地点          | 安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座国元证券    |
| 临时公告披露的指定网站查询日期（如有） | —                             |
| 临时公告披露的指定网站查询索引（如有） | —                             |

### 3、其他有关资料

其他有关资料在报告期是否变更情况

□ 适用 √ 不适用

### 四、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

合并

|                           | 本报告期              | 上年同期              | 本报告期比上年同期增减  |
|---------------------------|-------------------|-------------------|--------------|
| 营业收入（元）                   | 1,571,612,017.32  | 1,402,827,242.31  | 12.03%       |
| 归属于上市公司股东的净利润（元）          | 513,718,293.29    | 510,562,083.71    | 0.62%        |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元） | 513,571,210.62    | 503,784,641.17    | 1.94%        |
| 其他综合收益（元）                 | -77,417,123.72    | 31,765,699.13     | -343.71%     |
| 经营活动产生的现金流量净额（元）          | 726,192,027.18    | -1,476,540,510.46 | ----         |
| 基本每股收益（元/股）               | 0.17              | 0.18              | -5.56%       |
| 稀释每股收益（元/股）               | 0.17              | 0.18              | -5.56%       |
| 加权平均净资产收益率                | 2.46%             | 2.54%             | 减少0.08个百分点   |
|                           | 本报告期末             | 上年度末              | 本报告期末比上年度末增减 |
| 资产总额（元）                   | 72,993,162,930.66 | 71,689,042,611.68 | 1.82%        |
| 负债总额（元）                   | 52,266,625,831.26 | 50,803,547,043.61 | 2.88%        |
| 归属于上市公司股东的净资产（元）          | 20,589,087,463.93 | 20,742,066,088.48 | -0.74%       |

母公司

|         | 本报告期             | 上年同期             | 本报告期比上年同期增减 |
|---------|------------------|------------------|-------------|
| 营业收入（元） | 1,318,410,070.05 | 1,205,181,681.89 | 9.40%       |
| 净利润（元）  | 403,262,957.84   | 411,752,997.17   | -2.06%      |

|                  |                   |                   |              |
|------------------|-------------------|-------------------|--------------|
| 其他综合收益（元）        | -77,071,445.96    | -19,381,843.56    | ----         |
| 经营活动产生的现金流量净额（元） | 515,082,782.22    | -1,325,973,040.61 | ----         |
| 基本每股收益（元/股）      | 0.14              | 0.14              | 0.00%        |
| 稀释每股收益（元/股）      | 0.14              | 0.14              | 0.00%        |
| 加权平均净资产收益率       | 2.02%             | 2.15%             | 减少0.13个百分点   |
|                  | 本报告期末             | 上年度末              | 本报告期末比上年度末增减 |
| 资产总额（元）          | 52,851,665,462.03 | 54,381,291,454.45 | -2.81%       |
| 负债总额（元）          | 33,192,863,382.91 | 34,459,450,887.21 | -3.68%       |
| 所有者权益总额（元）       | 19,658,802,079.12 | 19,921,840,567.24 | -1.32%       |

注：基本每股收益去年同期数，已按转增股份数与去年同期回购股份数作相应调整。

## 五、境内外会计准则下会计数据差异

### 1、同时按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用  不适用

### 2、同时按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

适用  不适用

### 3、境内外会计准则下会计数据差异原因说明

适用  不适用

## 六、非经常性损益项目及金额

适用  不适用

单位：元

| 项目   | 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）                          | 160,704.40   |    |
| 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）        | 5,877,200.00 |    |
| 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  | -5,314,257.96 |    |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目   |               |    |
| 减: 所得税影响额   | 191,605.87    |    |
| 少数股东权益影响额(税后)   | 384,957.90    |    |
| 合计  | 147,082.67    | -- |

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 | 483,733,348.88 | 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 |



|                 |  |  |
|-----------------|--|--|
| 可供出售金融资产取得的投资收益 |  | 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；保险兼业代理。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等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、可供出售金融资产等取得的投资收益 825,322,268.51 元，持有交易性金融资产等产生的公允价值变动损益-341,588,919.63 元。 |
|-----------------|--|--|

## 七、母公司净资产及有关风险控制指标

单位：元

| 项目                | 本报告期末             | 上年度末              | 本报告期末比上年度末增减  |
|-------------------|-------------------|-------------------|---------------|
| 核心净资产             | 11,207,253,251.61 | 11,435,092,560.77 | -1.99%        |
| 附属净资产             | -                 | 1,748,267,730.34  | -100.00%      |
| 净资产               | 11,207,253,251.61 | 13,183,360,291.11 | -14.99%       |
| 净资产               | 19,658,802,079.12 | 19,921,840,567.24 | -1.32%        |
| 各项风险资本准备之和        | 4,448,069,696.68  | 4,799,109,479.06  | -7.31%        |
| 表内外资产总额           | 41,081,469,478.91 | 41,445,992,409.97 | -0.88%        |
| 风险覆盖率             | 251.96%           | 274.70%           | 减少 22.74 个百分点 |
| 资本杠杆率             | 27.43%            | 27.74%            | 减少 0.31 个百分点  |
| 流动性覆盖率            | 303.20%           | 329.60%           | 减少 26.40 个百分点 |
| 净稳定资金率            | 122.90%           | 127.63%           | 减少 4.73 个百分点  |
| 净资产/净资产           | 57.01%            | 66.18%            | 减少 9.17 个百分点  |
| 净资产/负债            | 54.07%            | 62.61%            | 减少 8.54 个百分点  |
| 净资产/负债            | 94.85%            | 94.61%            | 增加 0.24 个百分点  |
| 自营权益类证券及证券衍生品/净资产 | 9.66%             | 39.55%            | 减少 29.89 个百分点 |
| 自营固定收益类证券/净资产     | 82.27%            | 55.09%            | 增加 27.18 个百分点 |

## 第三节 公司业务概要

### 一、报告期内公司从事的主要业务

在经历了 2016 年低位震荡之后，2017 年上半年国内股票市场主要指数整体小幅上涨，但振幅继续收窄，成交量相比前两季度也继续萎缩。上半年上证综指上涨 2.86%，深圳成指上涨 3.46%，两市 A 股成交额 51.91 万亿元，同比下降 18.45%；IPO 发行审核保持较快速度，上半年 IPO 家数共 247 家，同比增长 304.92%，融资额 1,253.96 亿元，同比增长 342.29%；受监管政策影响，再融资市场明显降温，上半年再融资（含增发、配股、可转债）家数 268 家，同比下降 35.58%，再融资金额 7,158.08 亿元，同比下降 21.37%；截至 2017 年 6 月末，沪深两市融资融券余额为 8,798.62 亿元，同比增长 3.08%。（以上数据来源：万得资讯）

报告期内，公司证券业务牌照齐全，主要业务包括经纪业务、证券信用业务、投行业务、自营投资业务、资产管理业务等。2017 年以来，公司按照年初既定的工作思路，强化管理、抢抓机遇，坚持稳健经营，严守风控合规，传统业务与创新业务同步推进，取得了良好的经营业绩。根据万得资讯统计，报告期内母公司股票代理交易金额行业排名第 28 位；股票主承销金额（含 IPO、增发、配股）行业排名第 21 位；债券承销金额行业排名第 62 位；推荐新三板挂牌家数行业排名第 26 位；报告期末融资融券余额行业排名第 20 位。公司主要业务的经营情况详见本报告“第四节经营情况讨论与分析”。

### 二、主要资产重大变化情况

#### 1、主要资产重大变化情况

| 主要资产 | 重大变化说明         |
|------|----------------|
| 应收款项 | 主要为应收证券清算款减少所致 |

#### 2、主要境外资产情况

适用  不适用

### 三、核心竞争力分析

1、公司资本金较为充实，有助于抵御各种风险，为公司传统资本型与创新资本型业务发展提供有力支持，为各项业务的发展奠定坚实基础。

2、公司业务资质较齐全，拥有证券经纪、自营、投行、资管、融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易、代销金融产品、中小企业私募债券承销、保险兼业代理等各种业务资格，为各项业务发展提供了广阔空间。

3、公司文化底蕴深厚，经营风格稳健，管理团队和谐稳定、经验丰富，为公司风险控制提供软实力保障，有助于公司各项业务的稳步发展。

4、公司风控合规能力强，拥有全方位、多层次的合规风控体系，各项合规风控制度细致完备，全员合规风控意识较强。

5、公司成本费用控制能力强，整体有效，经营财务预算约束力强，成本控制意识深入到各业务发展之中。

6、公司拥有安徽地域市场优势，多年精耕细作安徽市场，与省内客户保持良好关系。国内市场拓展卓有成效，客户服务能力稳步提高，积累了一批优质客户资源。

7、公司境外业务持续拓展，全资子公司国元香港经过十多年发展，已具备一定的竞争优势。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、概述

2017年上半年,面对机遇与挑战并存的市场环境,公司围绕“十三五”规划目标,按照年初确定的“坚持稳中求进、注重提质增效、增进业务协同、实现争先进位”工作思路,稳妥推进机制改革,进一步激发一线业务经营活力;持续推进互联网证券,精准运用线上线下合作营销,大力提升新客户开发能力;进一步完善风控、合规与稽核体系建设,有效提升风险管控能力;获得短期融资券发行资格,资金管理能力和效率再上新台阶;“两学一做”学习教育常态化、制度化,完成基层组织换届调整。上半年,公司各业务在“抓机遇、拓市场、抢份额、强管理”等方面完成大量扎实的基础性工作,严守风险底线,取得较好的经营业绩。

2017年上半年,公司实现营业收入15.72亿元,同比增长12.03%;营业支出9.01亿元,同比增长12.48%;利润总额6.71亿元,同比增长9.66%;归属于母公司股东的净利润5.14亿元,同比增长0.62%;基本每股收益0.17元,同比减少0.01元;加权平均净资产收益率2.46%,同比减少0.08个百分点。公司经营活动净现金流为7.26亿元,去年同期为-14.77亿元;公司投资活动净现金流为-0.24亿元,去年同期为-8.82亿元;公司筹资活动净现金流为-18.36亿元,去年同期为-30.22亿元。截至2017年6月30日,公司资产总额729.93亿元,同比增长1.82%;负债总额522.67亿元,同比增长2.88%;归属于母公司股东权益205.89亿元,同比下降0.74%;净资本112.07亿元,同比下降14.99%;净资本与净资产之比为57.01%,同比减少9.17个百分点;风险覆盖率251.96%,同比减少22.74个百分点;流动性覆盖率303.20%,同比减少26.40个百分点;净稳定资金率122.90%,同比减少4.73个百分点。

### 二、主营业务分析

#### 概述

#### 1、收入

公司报告期内,主营业务收入结构变化情况:

单位:元

| 业务分类 | 收入项目 | 2017年1-6月 |              | 2016年1-6月 |              | 同比增减(%) |
|------|------|-----------|--------------|-----------|--------------|---------|
|      |      | 金额        | 占公司总收入的比重(%) | 金额        | 占公司总收入的比重(%) |         |
|      |      |           |              |           |              |         |

|        |                       |                       |               |                       |               |                |
|--------|-----------------------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|----------------|
| 经纪业务   | 代理买卖手续费净收入            | 368,463,216.24        | 23.44%        | 510,855,525.54        | 36.42%        | -27.87%        |
|        | 出租席位净收入               | 2,028,540.97          | 0.13%         | 4,654,343.59          | 0.33%         | -56.42%        |
|        | 代理销售金融产品净收入           | 986,796.76            | 0.06%         | 3,481,363.34          | 0.25%         | -71.65%        |
|        | 客户保证金利差收入等            | 130,042,910.54        | 8.27%         | 144,692,902.26        | 10.31%        | -10.12%        |
|        | <b>小计</b>             | <b>501,521,464.51</b> | <b>31.90%</b> | <b>663,684,134.73</b> | <b>47.31%</b> | <b>-24.43%</b> |
| 证券信用业务 | 利息净收入                 | 349,515,398.75        | 22.24%        | 403,977,372.66        | 28.81%        | -13.48%        |
|        | <b>小计</b>             | <b>349,515,398.75</b> | <b>22.24%</b> | <b>403,977,372.66</b> | <b>28.81%</b> | <b>-13.48%</b> |
| 投资银行业务 | 证券承销业务净收入             | 137,208,727.49        | 8.73%         | 120,810,836.63        | 8.61%         | 13.57%         |
|        | 保荐业务净收入               | 6,809,222.77          | 0.43%         | 12,461,974.18         | 0.89%         | -45.36%        |
|        | 财务顾问业务净收入             | 40,336,837.39         | 2.57%         | 45,822,256.15         | 3.27%         | -11.97%        |
|        | <b>小计</b>             | <b>184,354,787.65</b> | <b>11.73%</b> | <b>179,095,066.96</b> | <b>12.77%</b> | <b>2.94%</b>   |
| 自营投资业务 | 交易性金融工具的投资收益和公允价值变动损益 | 72,303,539.89         | 4.60%         | 6,507,736.62          | 0.46%         | 1011.04%       |
|        | 可供出售金融资产的投资收益         | 309,786,336.21        | 19.71%        | 127,934,403.08        | 9.12%         | 142.14%        |
|        | 持有至到期金融资产的投资收益        | 778,579.96            | 0.05%         | 1,586,918.06          | 0.11%         | -50.94%        |
|        | 衍生金融工具的投资收益           | -10,065,913.55        | -0.64%        | -15,595,674.78        | -1.11%        | ---            |
|        | 其他收入                  | -13,509,848.60        | -0.86%        | -2,796,200.27         | -0.20%        | ---            |
|        | <b>小计</b>             | <b>359,292,693.91</b> | <b>22.86%</b> | <b>117,637,182.71</b> | <b>8.38%</b>  | <b>205.42%</b> |
| 资产管理业务 | 定向资产管理业务净收入           | 19,602,686.72         | 1.25%         | 8,992,723.06          | 0.64%         | 117.98%        |
|        | 集合资产管理业务净收入           | 38,366,777.31         | 2.44%         | 23,881,702.78         | 1.70%         | 60.65%         |
|        | 专项资产管理业务净收入           | 943,396.23            | 0.06%         | -                     | 0.00%         | ---            |
|        | <b>小计</b>             | <b>58,912,860.26</b>  | <b>3.75%</b>  | <b>32,874,425.84</b>  | <b>2.34%</b>  | <b>79.21%</b>  |

说明：以上收入为公司合并报表数据，含控股子公司各项业务数据。2017上半年，公司主营业务收入占公司总营业收入的比重为92.48%。经纪业务实现收入占公司总收入的比重同比下降，合计实现收入占公司总收入31.90%，同比减少15.41个百分点；投资银行业务实现营业收入占公司总收入比重为11.73%，同比减少1.04个百分点；自营投资业务收入占公司总收入的比重为22.86%，同比增加14.48个百分点；证券信用业务实现净收入占总收入比重为22.24%，同比减少6.57个百分点。

- 1、 自营投资业务净收入同比增加205.42%，主要为处置金融资产所致；
- 2、 资产管理业务净收入同比增加79.21%，主要为集合资产规模扩大导致收入增加所致。

## 2、成本

单位：元

| 行业分类 | 项目 | 2017年1-6月 |            | 2016年1-6月 |            | 同比增减(%) |
|------|----|-----------|------------|-----------|------------|---------|
|      |    | 金额        | 占营业成本比重(%) | 金额        | 占营业成本比重(%) |         |
|      |    |           |            |           |            |         |

|        |           |                       |               |                       |               |                |
|--------|-----------|-----------------------|---------------|-----------------------|---------------|----------------|
| 经纪业务   | 运营成本      | 44,933,696.84         | 4.99%         | 37,066,043.92         | 4.63%         | 21.23%         |
|        | 物业及设备成本   | 63,236,175.53         | 7.02%         | 61,375,983.72         | 7.66%         | 3.03%          |
|        | 人工成本      | 204,497,639.94        | 22.70%        | 197,265,200.82        | 24.63%        | 3.67%          |
|        | 其他成本      | 25,193,047.61         | 2.80%         | 44,063,576.71         | 5.50%         | -42.83%        |
|        | <b>小计</b> | <b>337,860,559.92</b> | <b>37.51%</b> | <b>339,770,805.17</b> | <b>42.42%</b> | <b>-0.56%</b>  |
| 证券信用业务 | 运营成本      | 1,085,886.42          | 0.12%         | 1,974,193.94          | 0.25%         | -45.00%        |
|        | 物业及设备成本   | 56,497.32             | 0.01%         | 3,171,564.19          | 0.40%         | -98.22%        |
|        | 人工成本      | 2,000,138.14          | 0.22%         | 6,207,959.15          | 0.78%         | -67.78%        |
|        | 其他成本      | 18,051,067.12         | 2.00%         | 17,783,340.31         | 2.22%         | 1.51%          |
|        | <b>小计</b> | <b>21,193,589.00</b>  | <b>2.35%</b>  | <b>29,137,057.59</b>  | <b>3.65%</b>  | <b>-27.26%</b> |
| 投资银行业务 | 运营成本      | 4,870,549.26          | 0.54%         | 1,398,264.50          | 0.17%         | 248.33%        |
|        | 物业及设备成本   | 2,752,554.26          | 0.31%         | 888,697.82            | 0.11%         | 209.73%        |
|        | 人工成本      | 99,142,105.31         | 11.00%        | 67,608,265.30         | 8.44%         | 46.64%         |
|        | 其他成本      | 2,527,127.32          | 0.28%         | 7,616,630.30          | 0.95%         | -66.82%        |
|        | <b>小计</b> | <b>109,292,336.15</b> | <b>12.13%</b> | <b>77,511,857.92</b>  | <b>9.67%</b>  | <b>41.00%</b>  |
| 自营投资业务 | 运营成本      | 2,527,991.52          | 0.28%         | 562,359.27            | 0.07%         | 349.53%        |
|        | 物业及设备成本   | 459,257.49            | 0.05%         | 53,466.92             | 0.01%         | 758.96%        |
|        | 人工成本      | 5,364,852.00          | 0.60%         | 7,042,412.71          | 0.88%         | -23.82%        |
|        | 其他成本      | -261,275.82           | -0.03%        | 1,379,471.09          | 0.17%         | -118.94%       |
|        | <b>小计</b> | <b>8,090,825.19</b>   | <b>0.90%</b>  | <b>9,037,709.99</b>   | <b>1.13%</b>  | <b>-10.48%</b> |
| 资产管理业务 | 运营成本      | 4,126,041.87          | 0.46%         | 1,508,643.13          | 0.19%         | 173.49%        |
|        | 物业及设备成本   | 2,116,011.39          | 0.23%         | 87,308.82             | 0.01%         | 2323.59%       |
|        | 人工成本      | 23,602,063.22         | 2.62%         | 35,286,035.99         | 4.41%         | -33.11%        |
|        | 其他成本      | 1,573,436.13          | 0.17%         | 3,387,902.40          | 0.42%         | -53.56%        |
|        | <b>小计</b> | <b>31,417,552.61</b>  | <b>3.48%</b>  | <b>40,269,890.34</b>  | <b>5.03%</b>  | <b>-21.98%</b> |

说明：投资银行业务营业成本同比增长 41.00%，主要为人工成本上升所致。

### 3、费用

单位：元

| 项目          | 2017年1-6月      | 2016年1-6月      | 同比增减   |
|-------------|----------------|----------------|--------|
| 工资、奖金、津贴、补贴 | 570,604,969.11 | 444,954,776.38 | 28.24% |
| 折旧费         | 44,860,285.80  | 47,665,125.07  | -5.88% |
| 社会保险费       | 42,240,494.64  | 37,574,470.54  | 12.42% |
| 租赁费         | 31,438,606.57  | 24,313,541.32  | 29.30% |
| 业务招待费       | 19,370,833.22  | 16,446,579.55  | 17.78% |

|       |               |               |        |
|-------|---------------|---------------|--------|
| 福利费   | 16,848,911.04 | 15,691,681.81 | 7.37%  |
| 邮电通讯费 | 15,930,975.14 | 15,336,722.97 | 3.87%  |
| 车辆使用费 | 14,338,173.35 | 12,877,935.45 | 11.34% |
| 住房公积金 | 13,407,616.52 | 13,243,174.43 | 1.24%  |
| 差旅费   | 10,180,652.66 | 7,980,553.74  | 27.57% |

#### 4、研发投入

适用  不适用

#### 5、现金流

单位：元

| 项目            | 2017年1-6月         | 2016年1-6月         | 同比增减    |
|---------------|-------------------|-------------------|---------|
| 经营活动现金流入小计    | 4,330,513,671.37  | 6,306,430,695.86  | -31.33% |
| 经营活动现金流出小计    | 3,604,321,644.19  | 7,782,971,206.32  | -53.69% |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 726,192,027.18    | -1,476,540,510.46 | -       |
| 投资活动现金流入小计    | 20,621,460.73     | 31,237,418.31     | -33.98% |
| 投资活动现金流出小计    | 44,827,900.47     | 913,680,565.31    | -95.09% |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -24,206,439.74    | -882,443,147.00   | -       |
| 筹资活动现金流入小计    | 5,480,602,600.00  | 2,133,064,670.00  | 156.94% |
| 筹资活动现金流出小计    | 7,316,643,666.54  | 5,155,220,500.19  | 41.93%  |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -1,836,041,066.54 | -3,022,155,830.19 | -       |
| 现金及现金等价物净增加额  | -1,165,705,416.34 | -5,350,848,401.08 | -       |

说明：经营活动现金流入同比下降31.33%，主要为融出资金同比流出所致；经营活动现金流出同比下降53.69%，主要为回购业务同比流入所致；投资活动现金流入同比下降33.98%，主要联营公司分红减少所致；投资活动现金流出同比下降95.09%，主要为去年同期投资联营公司安元基金所致；筹资活动现金流入同比增长156.94%，主要为发行短融与收益凭证融入资金增加所致；筹资活动现金流出同比增长41.93%，主要为偿还债务支付现金增加所致。

#### 主要财务数据同比变动情况

单位：元

|               | 本报告期             | 上年同期              | 同比增减   | 变动原因            |
|---------------|------------------|-------------------|--------|-----------------|
| 营业收入          | 1,571,612,017.32 | 1,402,827,242.31  | 12.03% |                 |
| 营业支出          | 900,979,422.13   | 800,997,190.85    | 12.48% |                 |
| 所得税费用         | 153,667,586.58   | 98,462,885.26     | 56.07% |                 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 726,192,027.18   | -1,476,540,510.46 | ---    | 主要为回购业务资金流入增加所致 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -24,206,439.74   | -882,443,147.00   | ---    | 主要为去年同期投资安元基金所致 |

|               |                   |                   |     |                     |
|---------------|-------------------|-------------------|-----|---------------------|
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -1,836,041,066.54 | -3,022,155,830.19 | --- | 主要为本报告期融资增加所致       |
| 现金及现金等价物净增加额  | -1,165,705,416.34 | -5,350,848,401.08 | --- | 主要为融资增加以及回购资金流入增加所致 |

公司报告期利润构成或利润来源发生重大变动

适用  不适用

公司报告期利润构成或利润来源没有发生重大变动。

### 三、主营业务构成情况

#### 1、主营业务分业务情况

单位：元

| 业务类别   | 营业收入           | 营业支出           | 营业利润率  | 营业收入比上年同期增减 | 营业支出比上年同期增减 | 营业利润率比上年同期增减  |
|--------|----------------|----------------|--------|-------------|-------------|---------------|
| 经纪业务   | 501,521,464.51 | 337,860,559.92 | 32.63% | -24.43%     | -0.56%      | 减少 16.17 个百分点 |
| 证券信用业务 | 349,515,398.75 | 21,193,589.00  | 93.94% | -13.48%     | -27.26%     | 增加 1.15 个百分点  |
| 投资银行业务 | 184,354,787.65 | 109,292,336.15 | 40.72% | 2.94%       | 41.00%      | 减少 16 个百分点    |
| 自营投资业务 | 359,292,693.91 | 8,090,825.19   | 97.75% | 205.42%     | -10.48%     | 增加 5.43 个百分点  |
| 资产管理业务 | 58,912,860.26  | 31,417,552.61  | 46.67% | 79.21%      | -21.98%     | 增加 69.17 个百分点 |

#### 主营业务分业务情况说明

##### 1、经纪业务

2017年上半年，我国A股市场成交量较为低迷，两市成交额同比下降18.45%，行业经纪业务竞争净佣金率进一步下滑，下降幅度超过16%。面对这种不利局面，公司经纪业务按照强本固基、再谋发展的主基调，坚持线上线下协调发展，狠抓基础管理和基础营销，稳定和激活存量客户，在坚守合规风控底线的同时，紧盯市场，对标挖潜，积极推进公司零售经纪业务的发展。调整经纪业务管理框架，建立以分公司为核心的经纪业务经营管理体系，推动落实简政放权，提升经营管理效能；优化网点布局，拓展业务辐射范围；督促网点加强管理，改善经营，提升盈利能力；调整分支机构考核指标体系，突出增量考核，激发网点业务拓展积极性；加强营销团队建设，巩固和深挖银行渠道资源，加大营销活动力度，做大客户群体和资产；以投顾业务为抓手，构建客户服务体系，探索财富管理路径；稳步推进产品销售工作，以客户需求为导向，坚持内设外引，加快产品线建设，为营销和服务提供支持；积极推广股票期权业务，加大创新业务对经纪业务的支持力度。

报告期内，公司实现经纪业务净收入50,152.15万元，比上年同期下降24.43%；发生经纪业务成本



33,786.06万元，比上年同期下降0.56%；实现经纪业务利润16,366.09万元，比上年同期下降49.47%。其中：母公司实现经纪业务收入42,286.39万元，比上年同期下降31.49%；发生经纪业务成本27,020.98万元，比上年同期下降2.75%；实现经纪业务利润15,265.41万元，比上年同期下降55.02%。国元香港实现经纪业务收入3,495.22万元，比上年同期增长125.71%；发生经纪业务成本3,194.65万元，比上年同期下降5.44%；实现经纪业务利润300.57万元，比上年同期增加2,130.43万元。国元期货实现经纪业务收入4,370.54万元，比上年同期增长40.93%；发生经纪业务成本3,570.43万元，比上年同期增长26.85%；实现经纪业务利润800.11万元，比上年同期增长179.28%。

## 2、证券信用业务

根据万得资讯，截至2017年6月末，沪深两市融资融券余额为8,798.62亿元，同比增长3.08%。2017年上半年，公司证券信用业务外抓市场拓展，内抓风险管理，丰富完善动态管理理念，提高灵活自主定价能力，再一次经受住了市场考验，取得了融资融券、股票质押两项业务的业务规模和市场占比双增长。截至2017年6月30日，母公司信用业务余额180.81亿元，同比增长23.75%，其中融资融券余额111.51亿元，同比增长17.59%；股票质押余额66.32亿元，同比增长46.05%；约定购回余额2.98亿元，同比下降49.23%。

报告期内，公司实现信用业务净收入34,951.54万元，比上年同期下降13.48%；发生信用业务成本2,119.36万元，比上年同期下降27.26%；实现信用业务利润32,832.18万元，比上年同期下降12.41%。其中，母公司实现信用业务收入31,137.28万元，比上年同期下降16.94%；发生信用业务成本2,119.36万元，比上年同期下降14.64%；实现信用业务利润29,017.92万元，比上年同期下降17.11%。国元香港实现信用业务利润3,814.26万元，比上年同期增长53.97%。

## 3、投资银行业务

2017年上半年，新股发行审核保持较快速度，但监管审核全面趋严；监管部门出台新政，再融资市场明显降温；在金融市场去杠杆的大背景下，债券发行量有所下降。公司投行业务积极应对监管政策的变化，继续将IPO作为业务重点发展方向，继续推动再融资、并购重组、可转债、新三板业务的发展；同时，在有效防控债券违约风险的基础之上，稳健开拓债券业务。上半年，公司共完成完成3个IPO、2个再融资、3个并购重组、1个可交换公司债券、3个企业债和1个公司债，推荐16家企业在新三板挂牌。

报告期内，公司实现投行业务净收入18,435.48万元，比上年同期增长2.94%；发生投行业务成本10,929.23万元，比上年同期增长41.00%；实现投行业务利润7,506.25万元，比上年同期下降26.11%。

## 4、自营投资业务

2017年上半年，我国证券市场在去杠杆、严监管作用下，市场成交持续低迷，结构化分化特征明显。

公司积极作为，固定收益业务踏准市场节拍，继续从一级市场配置信用债，积极进行回购交易，努力降低融资成本，持续对持仓品种进行跟踪管理，切实防范风险；权益投资业务波段操作，坚持“个股达到盈利目标就坚决止盈，回调补入”的原则，先后成功把握了“一带一路”、“粤港澳”、国企改革等主题投资机会；三板做市业务实地调研、规范运作；量化投资业务开始实盘操作，研究完善策略。

报告期内，公司实现自营业务收入 35,929.27 万元，比上年同期增长 205.42%；发生自营业务成本 809.08 万元，比上年同期下降 10.48%；实现自营业务利润 35,120.19 万元，比上年同期增长 223.39%。其中，母公司实现自营业务收入 26,918.32 万元，比上年同期增长 118.16%；发生自营业务成本 913.32 万元，比上年同期增长 1.06%；实现自营业务利润 26,005.00 万元，比上年同期增长 127.41%。国元香港实现自营业务利润 1,657.25 万元，国元创新实现投资业务利润 7,457.94 万元。

### 5、资产管理业务

2017 年上半年，公司资产管理业务在外部环境不断趋紧的压力下，强化平台意识，强化金融工具思维，确保了资产管理规模的稳定。主动管理规模稳步增长，可比产品市场排名较好；同业业务在坚守中创新，深度挖掘交易对手资源；大力拓展资产证券化业务；量化对冲产品取得突破；存量产品的持续营销工作有序开展。截至 2017 年 6 月 30 日，母公司资管规模 1,098.19 亿元，同比增长 16.29%。其中集合资产规模 196.34 亿元，同比增长 19.32%；定向资产规模 851.85 亿元，同比增长 9.24%；专项资产管理业务规模 50 亿元。

报告期内，公司实现资产管理业务收入 5,891.29 万元，比上年同期增长 79.21%；发生资产管理业务成本 3,141.76 万元，比上年同期下降 21.98%；实现资产管理业务利润 2,749.53 万元，比上年同期增加 3,489.08 万元。其中：母公司实现资产管理业务收入 5,063.44 万元，比上年同期增长 107.65%；发生资产管理业务成本 2,355.05 万元，比上年同期下降 40.97%；实现资产管理业务利润 2,708.39 万元，比上年同期增加 4,259.78 万元。国元香港实现资产管理业务利润 75.74 万元，国元期货实现资产管理业务利润-34.60 万元。

## 2、主营业务分地区情况

### (1) 营业收入地区分部情况(合并报表数据)

单位：元

| 地区  | 本报告期  |                | 上年同期  |                | 营业收入比上年同期增减 |
|-----|-------|----------------|-------|----------------|-------------|
|     | 营业部数量 | 营业收入           | 营业部数量 | 营业收入           |             |
| 安徽省 | 53    | 222,224,871.89 | 43    | 343,321,726.89 | -35.27%     |
| 北京市 | 3     | 17,067,106.49  | 2     | 22,047,816.05  | -22.59%     |

|      |     |                  |     |                  |         |
|------|-----|------------------|-----|------------------|---------|
| 上海市  | 8   | 42,796,229.26    | 7   | 66,150,577.43    | -35.30% |
| 广东省  | 13  | 46,407,374.62    | 9   | 66,436,952.43    | -30.15% |
| 山东省  | 8   | 28,262,846.70    | 6   | 42,157,558.15    | -32.96% |
| 辽宁省  | 4   | 11,064,892.63    | 4   | 17,045,069.46    | -35.08% |
| 天津市  | 2   | 2,519,355.94     | 2   | 3,876,459.07     | -35.01% |
| 江苏省  | 5   | 6,444,941.57     | 5   | 9,124,056.64     | -29.36% |
| 浙江省  | 14  | 19,217,849.60    | 7   | 24,884,437.70    | -22.77% |
| 重庆市  | 1   | 12,043,321.86    | 1   | 12,410,729.36    | -2.96%  |
| 福建省  | 2   | 3,203,923.18     | 2   | 5,547,918.26     | -42.25% |
| 河南省  | 4   | 3,838,499.96     | 2   | 4,766,330.46     | -19.47% |
| 湖南省  | 1   | 1,440,375.07     | 1   | 1,754,143.16     | -17.89% |
| 湖北省  | 2   | 3,373,864.20     | 1   | 5,534,895.20     | -39.04% |
| 贵州省  | 2   | 897,379.47       | 1   | 1,504,436.64     | -40.35% |
| 江西省  | 1   | 1,079,745.99     | 1   | 1,204,973.86     | -10.39% |
| 山西省  | 1   | 3,424,618.21     | 1   | 3,292,367.86     | 4.02%   |
| 陕西省  | 2   | 3,156,443.62     | 1   | 4,392,304.97     | -28.14% |
| 四川省  | 1   | 433,705.25       | 1   | 524,885.95       | -17.37% |
| 公司本部 | --- | 1,037,632,812.98 | --- | 700,623,300.71   | 48.10%  |
| 境内合计 | --- | 1,466,530,158.49 | --- | 1,336,600,940.25 | 9.72%   |
| 境外   | --- | 105,081,858.83   | --- | 66,226,302.06    | 58.67%  |
| 合计   | --- | 1,571,612,017.32 | --- | 1,402,827,242.31 | 12.03%  |

注：以上营业部数量不包括控股子公司的营业部数量；公司本部数据为母公司（除分支机构以外）、国元直投、国元期货、国元创新、安徽省股交中心数据。

## （2）营业利润地区分部情况（合并报表数据）

单位：元

| 地区  | 本报告期  |                | 上年同期  |                | 营业利润比上年同期增减 |
|-----|-------|----------------|-------|----------------|-------------|
|     | 营业部数量 | 营业利润           | 营业部数量 | 营业利润           |             |
| 安徽省 | 53    | 123,078,505.65 | 43    | 230,155,944.07 | -46.52%     |
| 北京市 | 3     | 5,169,021.44   | 2     | 11,560,561.48  | -55.29%     |
| 上海市 | 8     | 8,379,659.43   | 7     | 29,731,712.92  | -71.82%     |
| 广东省 | 13    | 4,970,204.16   | 9     | 25,158,612.57  | -80.24%     |
| 山东省 | 8     | 12,572,351.18  | 6     | 26,777,190.61  | -53.05%     |
| 辽宁省 | 4     | 2,759,658.22   | 4     | 7,625,456.23   | -63.81%     |

|      |     |                |     |                |           |
|------|-----|----------------|-----|----------------|-----------|
| 天津市  | 2   | -1,476,692.67  | 2   | 88,833.89      | -1762.31% |
| 江苏省  | 5   | -711,090.50    | 5   | 2,564,284.96   | -127.73%  |
| 浙江省  | 14  | -93,494.55     | 7   | 9,674,521.59   | -100.97%  |
| 重庆市  | 1   | 7,651,136.59   | 1   | 8,775,390.52   | -12.81%   |
| 福建省  | 2   | -892,462.09    | 2   | 920,052.49     | -197.00%  |
| 河南省  | 4   | -1,689,476.13  | 2   | 2,021,360.85   | -183.58%  |
| 湖南省  | 1   | -592,204.32    | 1   | -322,905.64    | ---       |
| 湖北省  | 2   | -825,645.16    | 1   | 1,512,219.86   | -154.60%  |
| 贵州省  | 2   | -747,109.91    | 1   | -179,492.86    | ---       |
| 江西省  | 1   | -626,590.11    | 1   | -630,357.70    | ---       |
| 山西省  | 1   | 2,158,589.89   | 1   | 1,801,178.98   | 19.84%    |
| 陕西省  | 2   | 516,997.32     | 1   | 1,648,132.54   | -68.63%   |
| 四川省  | 1   | -896,638.39    | 1   | -744,496.64    | ---       |
| 新疆   | 0   | -17,200.00     | 0   |                |           |
| 公司本部 | --- | 459,653,154.87 | --- | 215,557,524.49 | 113.24%   |
| 境内合计 | --- | 618,340,674.92 | --- | 573,695,725.21 | 7.78%     |
| 境外   | --- | 52,291,920.27  | --- | 28,134,326.25  | 85.87%    |
| 合计   | --- | 670,632,595.19 | --- | 601,830,051.46 | 11.43%    |

注：以上营业部数量不包括控股子公司的营业部数量；公司本部数据为母公司（除分支机构以外）、国元直投、国元期货、国元创新、安徽省股交中心数据。

#### 四、非主营业务分析

√ 适用 □ 不适用

单位：元

|        | 金额             | 占利润总额比例 | 形成原因说明   | 是否具有可持续性 |
|--------|----------------|---------|----------|----------|
| 资产减值   | -11,501,359.31 | -1.71%  | 根据公司会计政策 | 是        |
| 营业外收入  | 6,248,913.86   | 0.93%   | 补贴等收入    | 否        |
| 营业外支出  | 5,525,267.42   | 0.82%   | 对外捐赠等    | 是        |
| 其他业务收入 | 14,430,540.52  | 2.15%   | 房租等收入    | 是        |
| 其他业务成本 | 4,096,459.26   | 0.61%   | 开户费等成本   | 是        |

#### 五、资产及负债状况

##### 1、资产构成重大变动情况

单位：元

|                        | 本报告期末             |        | 本报告期初             |        | 比重增减   | 同比增减    | 重大变动说明                |
|------------------------|-------------------|--------|-------------------|--------|--------|---------|-----------------------|
|                        | 金额                | 占总资产比例 | 金额                | 占总资产比例 |        |         |                       |
| 货币资金                   | 16,716,084,200.51 | 22.90% | 18,091,790,597.18 | 25.24% | -2.34% | -7.60%  |                       |
| 结算备付金                  | 3,135,757,264.42  | 4.30%  | 2,925,756,284.09  | 4.08%  | 0.22%  | 7.18%   |                       |
| 融出资金                   | 13,300,011,483.43 | 18.22% | 12,227,464,711.38 | 17.06% | 1.16%  | 8.77%   |                       |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,290,128,720.17  | 1.77%  | 1,312,644,232.54  | 1.83%  | -0.06% | -1.72%  |                       |
| 买入返售金融资产               | 7,842,495,088.25  | 10.74% | 6,351,501,872.10  | 8.86%  | 1.88%  | 23.47%  |                       |
| 应收款项                   | 380,566,829.62    | 0.52%  | 653,505,903.26    | 0.91%  | -0.39% | -41.77% | 主要为应收证券清算款减少所致        |
| 应收利息                   | 877,665,722.94    | 1.20%  | 746,583,068.27    | 1.04%  | 0.16%  | 17.56%  |                       |
| 存出保证金                  | 48,450,613.03     | 0.07%  | 42,693,079.47     | 0.06%  | 0.01%  | 13.49%  |                       |
| 可供出售金融资产               | 25,100,306,490.58 | 34.39% | 25,045,207,832.19 | 34.94% | -0.55% | 0.22%   |                       |
| 持有至到期投资                | 18,858,165.76     | 0.03%  | 19,435,696.00     | 0.03%  | 0.00%  | -2.97%  |                       |
| 长期股权投资                 | 2,118,899,405.35  | 2.90%  | 2,094,747,875.63  | 2.92%  | -0.02% | 1.15%   |                       |
| 投资性房地产                 |                   | 0.00%  |                   | 0.00%  | 0.00%  |         |                       |
| 固定资产                   | 1,402,009,185.85  | 1.92%  | 1,430,567,270.23  | 2.00%  | -0.08% | -2.00%  |                       |
| 在建工程                   | 75,437,544.40     | 0.10%  | 71,183,732.09     | 0.10%  | 0.00%  | 5.98%   |                       |
| 无形资产                   | 37,418,105.16     | 0.05%  | 37,257,253.69     | 0.05%  | 0.00%  | 0.43%   |                       |
| 商誉                     | 122,706,581.19    | 0.17%  | 122,706,581.19    | 0.17%  | 0.00%  | 0.00%   |                       |
| 递延所得税资产                | 122,134,373.17    | 0.17%  | 160,620,050.37    | 0.22%  | -0.05% | -23.96% |                       |
| 其他资产                   | 404,233,156.83    | 0.55%  | 355,376,572.00    | 0.50%  | 0.05%  | 13.75%  |                       |
| 短期借款                   | 1,219,427,600.00  | 1.67%  | 975,005,000.00    | 1.36%  | 0.31%  | 25.07%  |                       |
| 应付短期融资款                | 9,616,604,257.98  | 13.17% | 8,136,090,000.00  | 11.35% | 1.82%  | 18.20%  |                       |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 11,372,270,008.52 | 15.58% | 9,896,296,729.50  | 13.80% | 1.78%  | 14.91%  |                       |
| 卖出回购金融资产款              | 5,987,430,227.50  | 8.20%  | 4,285,290,080.00  | 5.98%  | 2.22%  | 39.72%  | 正回购融入资金规模增加所致         |
| 代理买卖证券款                | 15,498,536,667.68 | 21.23% | 16,495,810,718.77 | 23.01% | -1.78% | -6.05%  |                       |
| 应付职工薪酬                 | 305,909,845.51    | 0.42%  | 398,469,269.22    | 0.56%  | -0.14% | -23.23% |                       |
| 应交税费                   | 95,917,125.75     | 0.13%  | 239,516,744.76    | 0.33%  | -0.20% | -59.95% | 本报告期缴纳2016年度汇算清缴所得税所致 |
| 应付款项                   | 528,047,582.87    | 0.72%  | 169,685,886.28    | 0.24%  | 0.48%  | 211.19% | 暂收待清算款所致              |

|         |                  |       |                  |        |        |         |          |
|---------|------------------|-------|------------------|--------|--------|---------|----------|
| 应付利息    | 370,689,698.65   | 0.51% | 462,116,746.70   | 0.64%  | -0.13% | -19.78% |          |
| 预计负债    | 5,592,088.55     | 0.01% | 5,592,088.55     | 0.01%  | 0.00%  | 0.00%   |          |
| 长期借款    |                  | 0.00% |                  | 0.00%  | 0.00%  |         |          |
| 应付债券    | 7,017,186,506.05 | 9.61% | 9,492,261,596.14 | 13.24% | -3.63% | -26.07% |          |
| 递延所得税负债 | 208,529,087.40   | 0.29% | 217,140,113.75   | 0.30%  | -0.01% | -3.97%  |          |
| 其他负债    | 40,485,134.80    | 0.06% | 30,272,069.94    | 0.04%  | 0.02%  | 33.74%  | 预提费用增加所致 |

## 2、以公允价值计量的资产和负债

√ 适用 □ 不适用

单位：元

| 项目                                  | 期初数               | 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        | 本期购买金额            | 本期出售金额            | 期末数               |
|-------------------------------------|-------------------|-----------------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 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) | 1,312,644,232.54  | 15,508,814.74   |                |                | 3,223,707,410.92  | 3,261,731,738.03  | 1,290,128,720.17  |
| 2. 衍生金融资产                           | 128,495,541.35    | -2,564,580.00   |                |                | 613,356,560.00    | 714,151,421.35    | 27,700,680.00     |
| 3. 可供出售金融资产                         | 25,045,207,832.19 |                 | -59,471,306.75 | -26,675,488.18 | 5,812,109,132.38  | 5,724,214,655.42  | 25,100,306,490.58 |
| 4. 被套期项目                            | 0.00              | 1,984,941.32    |                |                | 7,325,479.56      | 1,466,500.69      | 7,843,920.19      |
| 5. 买入返售金融资产                         | 6,351,501,872.10  |                 |                | 12,164,093.41  | 41,832,621,779.16 | 40,329,464,469.60 | 7,842,495,088.25  |
| 金融资产小计                              | 32,709,353,936.83 | 14,929,176.06   | -59,471,306.75 | -14,511,394.77 | 51,489,120,362.02 | 50,031,028,785.09 | 34,240,774,219.19 |
| 投资性房地产                              |                   |                 |                |                |                   |                   |                   |
| 生产性生物资产                             |                   |                 |                |                |                   |                   |                   |
| 其他                                  | 19,435,696.00     |                 |                |                |                   | 577,530.24        | 18,858,165.76     |
| 上述合计                                | 32,728,789,632.83 | 14,929,176.06   | -59,471,306.75 | -14,511,394.77 | 51,489,120,362.02 | 50,031,606,315.33 | 34,259,632,384.95 |
| 金融负债                                |                   |                 |                |                |                   |                   |                   |
| 1. 卖出回购金融资产款                        | 4,285,290,080.00  |                 |                |                | 78,859,873,199.55 | 77,157,733,052.05 | 5,987,430,227.50  |
| 2. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债           | 9,896,296,729.50  | -359,082,675.69 |                |                | 1,835,055,954.71  |                   | 11,372,270,008.52 |

报告期内公司主要资产计量属性是否发生重大变化

□ 是 √ 否

### 3、截至报告期末的资产权利受限情况

| 受限项目                          | 期末账面价值（元）                |
|-------------------------------|--------------------------|
| 为质押式回购业务而设定质押的交易性金融资产         | 36,750,000.00            |
| 其中：为债券质押式报价回购业务而设定质押的交易性金融资产  | 36,750,000.00            |
| 为质押式回购业务而设定质押的可供出售金融资产        | 8,987,899,865.84         |
| 其中：为债券质押式报价回购业务而设定质押的可供出售金融资产 | 218,274,000.00           |
| 为场外卖出回购业务而设定质押的信用业务债券收益权      | 1,731,131,610.65         |
| 银行存款                          | 6,000,000.00             |
| 合计                            | <b>10,761,781,476.49</b> |

除此之外，公司不存在其它资产抵押、质押、被查封、冻结、必须具有一定条件才能变现、无法变现、无法用于抵偿债务的情况和其他权利受限制的情况和安排，以及其他具有可对抗的第三人的优先偿付负债的情况。

### 六、比较式财务报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：元

| 项目                      | 本报告期           | 上年同期           | 增减       | 变动原因                    |
|-------------------------|----------------|----------------|----------|-------------------------|
| 手续费及佣金净收入- 资产管理业务手续费净收入 | 30,145,128.05  | 19,924,204.29  | 51.30%   | 集合资产规模扩大导致收入增加          |
| 投资收益                    | 856,010,681.03 | 567,957,501.63 | 50.72%   | 结构化产品合并所致               |
| 汇兑收益                    | 5,002,563.26   | 8,070,832.26   | -38.02%  | 香港子公司持有外币资产减少所致         |
| 其他业务收入                  | 14,430,540.52  | 7,560,091.91   | 90.88%   | 出租房产所致                  |
| 营业税金及附加                 | 16,164,407.63  | 66,638,821.21  | -75.74%  | 营改增所致                   |
| 其他业务成本                  | 4,096,459.26   | 1,615,927.34   | 153.51%  | 开户费大幅增加所致               |
| 营业外收入                   | 6,248,913.86   | 14,219,793.55  | -56.05%  | 政府补助减少所致                |
| 营业外支出                   | 5,525,267.42   | 3,840,865.84   | 43.85%   | 对外捐赠增加所致                |
| 所得税费用                   | 153,667,586.58 | 98,462,885.26  | 56.07%   | 应纳企业所得税额增加导致当期所得税费用增加所致 |
| 其他综合收益                  | -77,417,123.72 | 31,765,699.13  | -343.71% | 持有金融资产公允价值下降以及港币贬值所致    |

## 七、投资状况分析

### 1、总体情况

适用  不适用

| 报告期投资额（元） | 上年同期投资额（元）     | 变动幅度     |
|-----------|----------------|----------|
| 0.00      | 886,686,000.00 | -100.00% |

### 2、报告期内获取的重大的股权投资情况

适用  不适用

### 3、报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

适用  不适用

### 4、金融资产投资

#### (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         | 会计计量模式 | 期初账面价值         | 本期公允价值变动损益 | 计入权益的累计公允价值变动  | 本期购买金额         | 本期出售金额         | 报告期损益         | 期末账面价值         | 会计核算科目   | 资金来源 |
|------|--------|------------|----------------|--------|----------------|------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------|------|
| 资管产品 |        | 国元浦江1号普通级  | 517,544,050.07 | 公允价值   | 666,113,437.16 | 0.00       | 148,476,159.17 | -              | -              | -             | 666,020,209.24 | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 资管产品 |        | 国元元赢3号普通级  | 573,832,832.01 | 公允价值   | 122,015,543.63 | 0.00       | 9,659,179.05   | 457,290,000.00 | -              | -             | 583,492,011.06 | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 资管产品 |        | 国元元赢16号普通级 | 432,496,103.85 | 公允价值   | 617,559,526.52 | 0.00       | 46,612,499.51  | 72,560,000.00  | 206,609,354.58 | 18,821,022.93 | 479,108,603.36 | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 债券   | 122067 | 11南钢       | 465,435,620.64 | 公允价值   | 457,097,257.91 | 0.00       | -14,085,620.64 | -              | -              | 18,373,110.64 | 451,350,000.00 | 可供出售金融资产 | 自有资金 |



|                     |        |            |                   |      |                   |                 |                |                  |                  |                |                   |          |      |
|---------------------|--------|------------|-------------------|------|-------------------|-----------------|----------------|------------------|------------------|----------------|-------------------|----------|------|
| 债券                  | 122357 | 14浙证债      | 300,000,000.00    | 公允价值 | 306,817,800.00    | 0.00            | 450,000.00     | -                | -                | 6,933,962.28   | 300,450,000.00    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 债券                  | 122355 | 14齐鲁债      | 300,000,000.00    | 公允价值 | 307,506,300.00    | 0.00            | -30,000.00     | -                | -                | 6,933,962.28   | 299,970,000.00    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 股票                  | 300520 | 科大国创       | 41,500,000.00     | 公允价值 | 186,959,260.58    | 0.00            | 187,002,713.70 | -                | -                | -              | 228,502,713.70    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 资管产品                |        | 国元元赢11号普通级 | 199,205,203.58    | 公允价值 | 216,798,071.32    | 0.00            | 22,478,258.63  | -                | -                | -              | 221,683,462.21    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 理财产品                | 851126 | 月月赢1年期6号   | 200,000,000.00    | 公允价值 | 203,800,000.00    | 0.00            | 7,960,000.00   | -                | -                | -              | 207,960,000.00    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 资管产品                |        | 国元元赢1号B类   | 172,914,860.99    | 公允价值 | 194,294,998.59    | 0.00            | 28,257,283.39  | -                | -                | -              | 201,172,144.38    | 可供出售金融资产 | 自有资金 |
| 期末持有的其他证券投资         |        |            | 22,411,795,201.61 | —    | 22,803,529,148.86 | -341,588,919.63 | 131,975,466.81 | 8,513,292,022.86 | 8,780,803,539.56 | 459,346,778.93 | 22,497,031,736.59 | —        | —    |
| 合计                  |        |            | 25,614,723,872.75 | —    | 26,082,491,344.57 | -341,588,919.63 | 568,755,939.62 | 9,043,142,022.86 | 8,987,412,894.14 | 510,408,837.06 | 26,136,740,880.54 | —        | —    |
| 证券投资审批董事会公告披露日期     |        |            | 2016年3月29日        |      |                   |                 |                |                  |                  |                |                   |          |      |
| 证券投资审批股东会公告披露日期(如有) |        |            | —                 |      |                   |                 |                |                  |                  |                |                   |          |      |

(2) 衍生品投资情况

√ 适用 □ 不适用

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 | 报告期内购入金额 | 报告期内售出金额 | 计提减值准备金额 | 期末投资金额 | 期末投资金额占公司报告期末净资产 | 报告期实际损益金额 |
|------------|------|--------|---------|-------------|------|------|--------|----------|----------|----------|--------|------------------|-----------|
|            |      |        |         |             |      |      |        |          |          |          |        |                  |           |

|   |   |   |      |           |    |    |           |           | (如<br>有)  |   | 比例       |       |           |
|---|---|---|------|-----------|----|----|-----------|-----------|-----------|---|----------|-------|-----------|
| 股指期货  | --  | 否 | 股指期货 | 61,335.66 | -- | -- | 12,849.55 | 61,335.66 | 71,415.14 | 0 | 2,770.07 | 0.13% | -1,205.09 |
| 合计  |   |   |      | 61,335.66 | -- | -- | 12,849.55 | 61,335.66 | 71,415.14 | 0 | 2,770.07 | 0.13% | -1,205.09 |
| 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6月11日  |   |      |           |    |    |           |           |           |   |          |       |           |
| 衍生品投资审批股东会公告披露日期(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。<br>自营业务的股指期货投机业务涉及的风险点主要集中在:保证金管理、各合约资金分配比例、操作盈亏和强行平仓等方面。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,实行规模控制与持仓盈亏限额控制,采取合理确定追加保证金规模、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,控制股指期货投机业务风险敞口。 |   |      |           |    |    |           |           |           |   |          |       |           |
| 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具体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、报告期内买入金额、报告期内出售金额、期末投资金额均为套期保值合约金额。

## 八、重大资产和股权出售

### 1、出售重大资产情况

适用  不适用

### 2、出售重大股权情况

适用  不适用

## 九、主要控股参股公司分析

适用  不适用

单位：元

| 公司名称         | 公司类型 | 主要业务  | 所处行业 | 注册资本              | 总资产              | 净资产              | 营业收入           | 营业利润          | 净利润           |
|--------------|------|---|------|-------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|
| 国元证券（香港）有限公司 | 子公司  | 证券交易和咨询；期货交易和咨询；资产管理；发放贷款；证券投资；就机构融资提供意见。   | 证券   | 1,000,000,000（港币） | 4,642,942,335.59 | 1,227,824,287.00 | 105,081,858.83 | 52,291,920.27 | 44,349,470.27 |
| 国元股权投资有限公司   | 子公司  | 使用自有资金或设立直投资基金，对企业进行股权投资或债权投资，或投资于与股权投资、债权投资相关的其它投资基金；为客户提供与股权投资、债权投资相关的财务顾问服务；经中国证监会认可开展的其它业务。<br>【依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】 | 私募   | 1,000,000,000     | 1,405,858,399.53 | 1,347,713,362.07 | 10,702,648.75  | 6,518,149.21  | 2,046,226.93  |
| 国元期货有限公司     | 子公司  | 商品期货经纪业务；金融期货   | 期货   | 609,694,600       | 1,632,415,211.12 | 673,464,250.44   | 51,395,025.68  | 15,109,142.13 | 10,626,046.61 |

|                           |     |  |      |                   |                  |                  |               |               |               |
|---------------------------|-----|--|------|-------------------|------------------|------------------|---------------|---------------|---------------|
|                           |     | 经纪业务；<br>期货投资<br>咨询；资产<br>管理。  |      |                   |                  |                  |               |               |               |
| 国元创新投资<br>有限公司            | 子公司 | 项目投资；<br>投资管理；<br>投资信息<br>咨询；股权<br>投资（依法<br>须经批准<br>的项目，经<br>相关部门<br>批准后方<br>可开展经<br>营活动）。   | 投资   | 1,500,000<br>,000 | 1,878,986,679.51 | 1,638,257,590.06 | 77,759,710.24 | 74,566,418.72 | 59,798,060.75 |
| 安徽省股权托<br>管交易中心有<br>限责任公司 | 子公司 | 办理各类<br>非上市企<br>业股权集<br>中登记托<br>管，并提供<br>确权、非交<br>易过户、挂<br>失、查询、<br>分红派息<br>和股权质<br>押登记服<br>务；为股<br>权、债权和<br>其他权益<br>类产品的<br>挂牌、转<br>让、融资、<br>登记、托<br>管、结算提<br>供场所、设<br>施和服务；<br>为企业债<br>权备案与<br>交易、理财<br>产品交易<br>金融产品<br>交易提供<br>服务；为企<br>业改制、重 | 金融服务 | 200,000,0<br>00   | 460,955,258.04   | 245,549,904.69   | 18,262,703.77 | 6,828,684.44  | 7,608,970.07  |

|                |      |   |      |               |                  |                  |                |                |               |
|----------------|------|---|------|---------------|------------------|------------------|----------------|----------------|---------------|
|                |      | 组、并购、上市、投资提供业务咨询服务；与上述经营范围相关的产品和服务的信息发布；其他经监管部门核准的业务。 |      |               |                  |                  |                |                |               |
| 长盛基金管理有限公司     | 参股公司 | 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。                          | 基金   | 189,000,000   | 1,365,588,089.78 | 1,073,119,206.00 | 299,660,668.41 | 102,164,096.76 | 77,308,872.45 |
| 安徽安元投资基金有限公司   | 参股公司 | 股权投资；基金投资；债权及其他投资；投资顾问、管理及咨询。                         | 私募基金 | 3,000,000,000 | 3,743,772,902.38 | 3,036,950,963.48 | 29,992,526.32  | 4,798,342.07   | 3,811,309.49  |
| 安徽安元投资基金管理有限公司 | 参股公司 | 受托管理股权投资基金企业的投资业务；投资顾问、投资管理、投资咨询。                     | 基金   | 50,000,000    | 79,762,886.37    | 77,886,646.45    | 26,603,202.74  | 19,759,074.20  | 14,823,760.02 |

### 主要控股参股公司情况说明

#### 1、国元证券（香港）有限公司

2017年上半年，国元香港全面扎实地开展各项工作，加快结构调整和创新步伐，积极推进重点业务转型升级，保持了持续、稳定的良好发展局面。完成两单投行项目，自营业务收益涨幅可观，期货业务强劲增长。

截至2017年6月30日，国元香港公司总资产464,294.23万元人民币，净资产122,782.43万元人民币，报告期内，实现营业收入10,508.19万元人民币，同比增长58.67%，营业利润5,229.19万元人民币，同比

增长85.87%，净利润4,434.95万元人民币，同比增长85.13%。

## 2、国元股权投资有限公司

2017年上半年，国元直投根据母公司“稳中求进”的工作主基调，依照“依法合规，稳健经营，巩固提高，创新发展”的工作思路，认真分析资本市场的最新变化，按照中国证券业协会《证券公司私募投资基金子公司管理规范》的相关规定，结合公司实际，努力做好转型和整改工作。目前，国元直投已被公示为第一批证券公司私募投资基金子公司，并成为中国证券业协会正式会员。

截至2017年6月30日，国元直投总资产140,585.84万元，净资产134,771.34万元，报告期内，实现营业收入1,070.26万元，同比下降36.94%，营业利润651.81万元，同比下降53.28%，净利润204.62万元，同比下降87.88%。

## 3、国元期货有限公司

2017年上半年，我国期货市场成交萎缩，商品期货成交下降，金融期货则出现恢复性增长。国元期货按照年初制定的“深化改革促发展，稳健经营增效益”的总体工作部署，增强竞争发展能力，提升核心竞争力深化业务转型，积极开展各项工作。

截至2017年6月30日，国元期货总资产163,241.52万元，净资产67,346.43万元，报告期内，实现营业收入5,139.50万元，同比增长32.84%，营业利润1,510.91万元，同比增长48.56%，净利润1,062.60万元，同比增长46.35%。

## 4、国元创新投资有限公司

2017年上半年，根据去年年底中国证券业协会公布的《证券公司另类投资子公司管理规范》的相关规定，国元创新在维持原有另类投资业务的基础上，增加开展股权投资业务。为贯彻行业监管政策的精神，国元创新结合实际，在保证公司稳健合规经营的基础上，逐步按照新的政策规范完成整改和转型。目前，国元创新已被公示为第三批证券公司另类投资子公司，并成为中国证券业协会正式会员。

截至2017年6月30日，国元创新总资产187,898.67万元，净资产163,825.76万元，报告期内，实现营业收入7,775.97万元，同比增长21.64%，营业利润7,456.64万元，同比增长17.48%，净利润5,979.81万元，同比增长25.29%。

## 5、安徽省股权托管交易中心有限责任公司

2017年上半年，安徽省股交中心适应新的政策和市场环境，积极筹划业务转型，主营业务保持了持续快速发展势头，新增挂牌企业214家，其中成长板12家、科技板75家、农业板62家、中医药板63家，累计挂牌企业1,396家；2家挂牌企业成功转板“新三板”，累计转板企业达到10家；新增托管企业217家（含挂牌企业）、股份18.69亿股，登记确权股东522户，累计托管企业1,609家；通过股权质押、私募股权融

资等方式帮助挂牌、托管企业实现融资11.88亿元，累计融资达到125.85亿元。

截至2017年6月30日，安徽省股交中心总资产46,095.53万元，净资产24,554.99万元，报告期内，实现营业收入1,826.27万元，同比增长54.35%，营业利润682.87万元，同比增长20.13%；净利润760.90万元，同比增长22.79%。

#### 6、长盛基金管理有限公司

2017年上半年，长盛基金紧紧围绕“以客户为中心、以产品为纽带、以业绩为引擎、以风控为护翼、以管理为基础、以机制为保障”的工作方针，坚持“稳中求进”的总基调，较好地完成了各项工作目标。

截至2017年6月30日，长盛基金总资产136,558.81万元，净资产107,311.92万元，报告期内，实现营业收入29,966.07万元，同比增长12.42%，营业利润10,216.41万元，同比增长5.06%；净利润7,730.89万元，同比增长6.20%。

#### 7、安徽安元投资基金有限公司

安元基金成立两年年来，取得良好业绩。2017年上半年，安元基金及子基金共完成投资项目17个，投资总额约4.12亿元；目前，安元基金已发起设立了黄山安元、亳州安元、淮北安元、安庆安元、滁州安元、六安安元、铜陵安元、阜阳安元等八只区域子基金，以及同创安元、加华安元、利得安元三只专项子基金。

截至2017年6月30日，安元基金总资产374,377.29万元，净资产303,695.10万元，报告期内，实现营业收入2,999.25万元，同比增长121.24%，营业利润479.83万元，同比增加533.59万元，净利润381.13万元，同比增加434.88万元。

#### 8、安徽安元投资基金管理有限公司

安元基金管理受安元基金的委托，为其提供投资管理服务，截至2017年6月30日，管理基金总规模130亿元。

截至2017年6月30日，安元基金管理总资产7,976.29万元，净资产7,788.66万元，报告期内，实现营业收入2,660.32万元，同比增长59.71%，营业利润1,975.91万元，同比增长81.65%，净利润1,482.38万元，同比增长81.71%。

## 十、公司控制的结构化主体情况

√ 适用 □ 不适用

截至2017年6月30日，本公司合并了18个结构化主体，此部分结构化主体全部为资产管理计划。对于该部分主体本公司同时作为管理人和投资人的情形，综合评估公司持有的投资份额以及作为管理人收取的管理费、分红等收益而享有可变回报的比重，判断本公司是否有能力运用对结构化主体的权力影响其回报，

并据此判断是否纳入将结构化主体纳入合并范围。2017年6月30日，纳入合并范围的18个结构化主体的总资产为人民币170.76亿元，具体情况见公司2017年半年度财务报表附注七。

## 十一、对 2017 年 1-9 月经营业绩的预计

适用  不适用

## 十二、公司面临的风险和应对措施

公司经营活动面临的具体风险及其表现：

### （1）合规与政策风险

本公司的经营受到国家财政、货币政策及税收、金融监管法规等多方面因素的影响。如本公司在经营中不能适应政策的变化，违反有关法律法规和政策的规定，可能会受到证券监管机构罚款、暂停或取消业务资格等行政处罚。报告期内，公司无重大纠纷仲裁事项，未受到行政处罚。

### （2）市场风险

证券市场景气程度受国民经济发展速度、宏观经济政策、利率、汇率、行业发展状况、投资心理以及国际经济金融环境等诸多因素影响，存在一定的不确定性和周期性。由于受经营模式、业务范围和金融产品的数量等因素的制约，证券公司的经营状况对市场行情及其走势有较强的依赖性，如果证券市场行情持续低迷，证券公司的经纪、投行、自营和资产管理等业务的经营难度将会增大，盈利水平将下降，市场价格如股价、利率、汇率等波动可能导致公司自营头寸、资管产品组合出现潜在亏损。国际市场的波动，对公司境外业务将产生较大影响。报告期内，市场风险主要表现为交易性金融资产、可供出售金融资产因股票市场价格变动而发生公允价值波动，佣金收入的起伏等。

### （3）信用风险

信用风险是指由于交易对手、客户、债券发行人及其他与公司有业务往来的机构未能履行约定契约中的义务，或因信用质量发生变化，影响金融产品价值，从而给公司造成经济损失的风险。目前，信用风险主要存在于公司的固定收益业务、融资融券业务、约定式购回业务、股票质押式回购业务、债券发行业务和另类投资上，如果出现公司交易对手违约、交易产品的信用等级下降等情形时，可能导致公司某一头寸或组合遭受损失，对公司财务状况产生不利影响。报告期内，融资融券业务、股票质押式回购业务等信用业务规模大幅增加，公司通过对购入产品评级限制，控制债券放大倍数，加强融资监控和管理等，未出现重大信用风险损失。

### （4）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。本公司在业务经营中，可能因业务规模大幅上升、履行大额表外担保和承诺、不能按计划完成外部融资、系统故障、人为操作失误等情形，造成公司流动性风险监管指标低于监管标准，或无法偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求。若外部市场发生重大变化，如融资市场紧缩、证券市场剧烈波动等可能导致公司出现金融资产无法及时通过合理价格变现来满足流动性要求。

如流动性风险监管指标（流动性覆盖率、净稳定资金率）低于监管标准，或发生重大流动性风险事件，则公司可能受到监管部门的处罚，对公司的业务资格、经营管理及公司声誉造成严重不利的影响。

公司严格按照证监会、证券业协会的要求，落实流动性风险管控措施，及时监控公司流动性状况变化，按照要求进行流动性风险压力测试，并通过拓展多元化融资渠道、优化融资结构、调整业务结构、控制业务节奏等措施，持续优化和改善公司流动性状况。报告期内，公司流动性风险监管指标持续满足监管要求，未发生流动性风险事件。

#### （5）操作与管理风险

本公司在各业务领域均制定了内部控制与风险管理措施，但任何控制制度均有其固有限制，可能因内部及外部环境发生变化、当事人的认知程度不够、执行人不严格执行现有制度、从业人员主观故意等情形，使内部控制机制的作用受到限制甚至失去效用，从而形成操作风险。同时，因业务流程的调整、新业务的产生、新技术的出现而改变原有业务模式和工作流程给公司带来的管理风险。本公司虽已建立严格的业务管理制度和工作流程，力图防止和发现有关欺诈或舞弊行为，但是尚不能做到完全杜绝和及时规避。报告期内，公司持续进行内控建设与评估，强化制度执行并着力完善各项制度和流程，没有发生对公司有实质性影响的操作风险。

#### （6）信息技术风险

信息技术在证券业已经得到广泛的应用，公司的集中交易、资金清算、财务核算、网上办公均高度依赖于信息技术的支持，电力保障、通讯保障、行业服务商水平、电子设备及系统软件质量、公司系统运维水平、计算机病毒、地震等自然灾害等都会对系统的设计和运行产生重大影响。当信息系统运行出现故障时，可能会导致公司交易系统受限甚至瘫痪，这将影响公司的正常业务和服务质量，损害公司的信誉，甚至会给公司带来经济损失和法律纠纷。报告期内，本公司加强信息技术系统的建设和运维，严格按照操作管理程序进行定期或不定期相结合的检查和维护，以保证系统的可靠、稳定和安全运转，没有产生重大信息技术风险。

#### （7）创新与行业竞争风险

目前，国内证券行业由传统的服务中介盈利模式向资本投资业务、资本中介业务等多元化盈利模式转型，券商原有优势逐渐消退，行业市场化竞争更为激烈。品种多元化、需求个性化的创新业务所带来的风险明显高于传统业务，呈现较强的隐蔽性和关联性。证券公司面临的风险复杂程度和风险量级成倍增加，经营业绩的不确定性也在逐步增大。在行业整体竞争格局重新确立的过程中，本公司的资本实力、竞争手段和盈利能力都将面临挑战。

针对上述风险，公司已（或拟）采取多种措施，对风险进行管理：

（1）完善公司治理结构，建立有效的内部控制机制

规范股东大会运作，保障所有股东特别是中小股东享有平等地位；规范和完善董事会运作，充分发挥专门委员会以及独立董事的作用；同时充分发挥监事会对董事会和经营层的监督作用。

公司结合实际情况，进行内控规范实施建设，制订并完善各项内部控制制度，建立有效的内部控制机制，逐步形成了“权责明确、逐级授权、相互制衡、严格监督”的治理结构，构建了四层次风险管理组织架构，确保公司对各种风险能够识别、监控和综合管理。公司内部控制覆盖公司所有业务、各个部门和分支机构、全体工作人员，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节，涵盖了事前防范、事中监控和事后检查各个阶段。目前，公司已在业务控制、信息隔离、会计系统控制、电子信息系统控制、人力资源控制、内部审计等方面形成了较完整的内部控制体系。

（2）优化业务制度流程，提高执行力，控制操作风险

为保证制度流程和风控措施有效执行，公司不断完善各项业务制度流程，对业务流程中不适应管理需要及运作要求的内容进行优化和修正，规避部分因操作不规范、执行不标准或部门间缺乏协调机制而引起的操作风险。报告期内，公司持续完善内控规范工作，根据业务变化对流程风险点、风险等级和控制措施等进行持续更新和完善，对执行不到位的环节进行整改并在年终进行绩效扣分。

（3）加强授权管理，建立防火墙机制

公司在法定经营范围内，对经依法批准开展经营的各业务部门和分支机构的业务权限，实行授权管理，各业务部门和分支机构必须在授权范围内办理业务，严禁越权从事业务活动，保证公司决策在纵向贯彻和传导上的畅通。公司在规章制度、资金财务及信息传递等方面建立了有效的防火墙机制，切实防范内幕交易和越权操作风险。

（4）夯实传统业务风险管理的同时，加大创新业务的风险管理

公司采用各种风险管理手段，夯实自营投资业务、资产管理业务、经纪业务、承销业务等传统业务风险管理的同时，在创新业务的风险管理上，通过加强对创新产品的研究和分析，建立创新金融产品三级审核机制，完善风险监控系統，制定风险管理政策，强化制度流程的执行与操作，测算业务规模和风险限额，

对新业务风险采取有针对性的措施，保障新产品、新业务风险可测、可控、可承受。信用类创新业务的开展，主要通过加强前期尽职调查，进行项目可行性分析，上报公司评审小组审议等程序后，项目方可实施。

(5) 加强技术建设，实现各主要业务和风控指标的实时监控

建立和规范风险管理部门参与重要业务决策风险评估机制，通过集中式风险监控系統、投資管理系統、淨資本監控系統、大集中交易及清算系統、財務系統等物理化軟、硬件系統，強化對風險的定量監測和管理。經過多年的研究開發和完備，公司已建立起一整套完備的、多層次的監控系統，對各項業務、反洗錢工作、信息隔離及風險控制指標進行有效地監控。同時，對安徽證監局開放上述監控系統的数据接口，保證監管機構能及時獲取真實、完整的監管信息。

(6) 實行考核評價，營造風險管理文化，加強監督檢查提高制度執行力

公司建立了風險管理考核體系，將各部門的風險管理評價結果納入績效考核，強化風險責任追究，保障風險管理體系的整體有效。公司通過培訓、考核、監督檢查等多種方式，提高員工風險意識和風險管理能力，樹立“風險控制是公司生命線”的理念，大力宣傳和營造全員風險管理文化，努力使風險管理成為員工自覺自願的行為，從根本上提高全員風險管理能力、提高對制度和流程的執行力。

### 十三、報告期內接待調研、溝通、採訪等活動登記表

| 接待時間       | 接待地點 | 接待方式 | 接待對象類型 | 接待對象  | 談論的主要內容及提供的資料          |
|------------|------|------|--------|---|------------------------|
| 2017年2月22日 | 公司   | 實地調研 | 機構     | 長江證券 周晶晶，平安資管<br>何曉波  | 公司2016年經營情況等           |
| 2017年3月1日  | 公司   | 實地調研 | 機構     | 安徽技術進出口公司 邵品<br>德，中信證券 曾征，華安證<br>券 汪雙秀、楊易，新安金融<br>崔正宏、畢鋒杰、宋梅竹，天<br>風證券 羅鈞輝、修佳林，<br>東吳證券 胡翔，吉富創投<br>張來 | 2016年主要業務開展情況等         |
| 2017年6月20日 | 公司   | 實地調研 | 機構     | 中泰證券 高崧   | 2017年1-5月主要業務開展情<br>況等 |

## 第五节 重要事项

### 一、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

#### 1、本报告期股东大会情况

| 会议届次           | 会议类型   | 投资者参与比例 | 召开日期       | 披露日期       | 披露索引   |
|----------------|--------|---------|------------|------------|--|
| 2017年第一次临时股东大会 | 临时股东大会 | 52.60%  | 2017年2月13日 | 2017年2月14日 | 详见披露在巨潮资讯网《国元证券股份有限公司2017年第一次临时股东大会决议公告》，公告编号：2017-007 |
| 2016年度股东大会     | 年度股东大会 | 52.88%  | 2017年5月8日  | 2017年5月9日  | 详见披露在巨潮资讯网《国元证券股份有限公司2016年度股东大会决议公告》，公告编号：2017-028     |

#### 2、表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用  不适用

### 二、本报告期利润分配及资本公积金转增股本预案

适用  不适用

公司计划半年度不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。

### 三、公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内履行完毕及截至报告期末尚未履行完毕的承诺事项

适用  不适用

| 承诺事由  | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|-------|-----|------|------|------|------|------|
| 股改承诺  |     |      |      |      |      |      |
| 收购报告书 |     |      |      |      |      |      |

|                       |   |                                       |  |            |    |           |
|-----------------------|---|---------------------------------------|--|------------|----|-----------|
| 或权益变动<br>报告书中所<br>作承诺 |   |                                       |  |            |    |           |
| 资产重组时<br>所作承诺         | 安徽国元控股（集团）有限<br>责任公司、安徽国元信托投资有<br>限责任公司（已更名为“安徽<br>国元信托有限责任公司”）、<br>安徽国元实业投资有限责任<br>公司，安徽省粮油食品进出口<br>（集团）公司，安徽省皖能股<br>份有限公司 | 其他承诺                                  | 将按照法律、法规及公司章程依法行使<br>股东权利，不利用股东身份影响上市公<br>司的独立性，保持上市公司在资产、人<br>员、财务、业务和机构等方面的独立性   | 2007年3月13日 | 长期 | 正常履行<br>中 |
|                       | 安徽国元控股（集团）有限责<br>任公司、安徽国元信托投资有<br>限责任公司（已更名为“安徽<br>国元信托有限责任公司”）、<br>安徽国元实业投资有限责任<br>公司                                      | 关于同业<br>竞争、关联<br>交易、资金<br>占用方面<br>的承诺 | 国元集团及国元信托、国元实业不从事、<br>且国元集团将通过法律程序确保国元集<br>团之其他全资、控股子公司均不从事任<br>何在商业上与公司经营的业务有直接竞<br>争的业务，规范关联交易，不会进行有<br>损本公司及其他股东利益的关联交易   | 2007年3月13日 | 长期 | 正常履行<br>中 |
|                       | 安徽省粮油食品进出口（集<br>团）公司、安徽省皖能股份有<br>限公司  | 关于同业<br>竞争、关联<br>交易、资金<br>占用方面<br>的承诺 | 不从事与公司构成竞争的业务，规范关<br>联交易，不会进行有损本公司及其他股<br>东利益的关联交易   | 2007年3月13日 | 长期 | 正常履行<br>中 |
|                       | 国元证券股份有限公司  | 其他承诺                                  | 1、公司上市以后，将严格遵守有关法律<br>法规关于信息披露的各项规定，诚信地<br>履行上市公司的信息披露义务；同时，<br>还将结合证券公司的特点，在定期报告<br>中充分披露客户资产保护状况，以及由<br>证券公司业务特点所决定的相关风险及<br>风险控制、风险管理情况、公司合规检<br>查、创新业务开展等信息。公司将进一<br>步采取切实措施，强化对投资者的风险<br>揭示和风险教育。<br>2、公司上市以后，将进一步严格按照《证<br>券公司风险控制指标管理办法》规定，<br>完善风险管理制度，健全风险监控机制，<br>发挥风险实时监控系统的的重要作用，建<br>立以净资本为核心的风险控制指标体<br>系，加强对风险的动态监控，增强识别、<br>度量、控制风险的能力，提高风险管理<br>水平。 | 2007年5月10日 | 长期 | 正常履行<br>中 |
| 首次公开发<br>行或再融资        | 安徽国元控股（集团）有限责<br>任公司、安徽国元信托有限责  | 其他承诺                                  | 不越权干预公司经营管理活动，不侵占<br>公司利益。   | 2016年7月4日  | 长期 | 正常履行<br>中 |

|            |                               |  |   |                         |                                  |       |
|------------|-------------------------------|--|---|-------------------------|----------------------------------|-------|
| 时所作承诺      | 任公司                           |  |   |                         |                                  |       |
|            | 公司董事、高级管理人员                   | 其他承诺   | <p>(一) 忠实、勤勉地履行职责，维护公司和全体股东的合法权益；</p> <p>(二) 不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；</p> <p>(三) 勤俭节约，严格按照国家、地方及公司有关规定对职务消费进行约束，不过度消费，不铺张浪费；</p> <p>(四) 不动用公司资产从事与本人履行职责无关的投资、消费活动；</p> <p>(五) 促使董事会或薪酬与提名委员会制订的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。</p> <p>(六) 如公司将来推出股权激励计划，则促使公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。</p>                               | 2016 年 7 月 4 日          | 长期                               | 正常履行中 |
|            | 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 | 其他承诺   | <p>本公司于国元证券股份有限公司 2016 年度非公开发行 A 股股票(下称“本次发行”)的定价基准日 2016 年 7 月 8 日前六个月至本承诺出具日，本公司没有减持国元证券股份有限公司股票的情况。</p> <p>本公司从国元证券股份有限公司本次发行定价基准日前六个月至本次发行完成后六个月内不减持本公司持有的国元证券股份有限公司股票。</p> <p>本公司、本公司直接或间接控制的企业及本公司的关联方不会违反《证券发行与承销管理办法》第十七条等有关法规的规定，不会且未曾直接或间接向参与国元证券股份有限公司本次发行的认购对象及参与本次认购的合伙企业及其合伙人提供财务资助或者补偿。</p> <p>本公司将公开披露上述承诺事项。</p> | 2016 年 11 月 14 日        | 公司 2016 年度非公开发行 A 股股票期间、发行后 6 个月 | 正常履行中 |
| 国元证券股份有限公司 | 其他承诺                          | <p>本公司、本公司直接或间接控制的企业及本公司的关联方不会违反《证券发行与承销管理办法》第十七条等有关法规的规定，不会且未曾直接或间接向参与本公司 2016 年度非公开发行 A 股股票的认购对象及参与本次认购的合伙企业及其合伙人提供财务资助或者补偿。</p> | 2016 年 11 月 14 日  | 公司 2016 年度非公开发行 A 股股票期间 | 正常履行中                            |       |

|                                       |     |  |                 |  |  |  |
|---------------------------------------|-----|--|-----------------|--|--|--|
|                                       |     |  | 本公司将公开披露上述承诺事项。 |  |  |  |
| 股权激励承诺                                |     |  |                 |  |  |  |
| 其他对公司中小股东所作承诺                         |     |  |                 |  |  |  |
| 承诺是否按时履行                              | 是   |  |                 |  |  |  |
| 如承诺超期未履行完毕的，应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划 | 不适用 |  |                 |  |  |  |

#### 四、聘任、解聘会计师事务所情况

半年度财务报告是否已经审计

是  否

公司半年度报告未经审计。

#### 五、董事会、监事会对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

适用  不适用

#### 六、董事会对上年度“非标准审计报告”相关情况的说明

适用  不适用

#### 七、破产重整相关事项

适用  不适用

公司报告期末发生破产重整相关事项。

#### 八、诉讼事项

重大诉讼仲裁事项

适用  不适用

本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项。

其他诉讼事项

√ 适用 □ 不适用

截至报告期末，公司未达到重大诉讼披露标准的其他诉讼涉案金额为 6,665.06 万元，预计负债为 559.21 万元，其中涉案金额超过 100 万元的诉讼事项如下：

| 诉讼(仲裁)基本情况  | 涉案金额<br>(万元) | 是否形成<br>预计负债 | 诉讼(仲<br>裁)进展 | 诉讼(仲裁)<br>审理结果及<br>影响                                    | 诉讼(仲<br>裁)判决<br>执行情况                                    | 披露日期            | 披露索引                  |
|---|--------------|--------------|--------------|--|---|-----------------|-----------------------|
| 方梅莲诉杭州密渡桥营业部侵权责任纠纷案件：本案的背景情况请参见本公司 2016 年年度报告。2017 年 3 月 31 日，浙江省象山县人民法院第一次开庭审理本案，并通知 2017 年 7 月 19 日第二次开庭审理。 | 1,465.19     | 是            | 法院审理中，尚未作出判决 | 不适用  | 不适用   | 2017 年 4 月 18 日 | 国元证券股份有限公司 2016 年年度报告 |
| “绿润债”债券回购合同纠纷案件：本案的背景情况请参见本公司 2016 年年度报告。2016 年 12 月 26 日，公司向法院申请强制执行，目前对方尚未履行判决，案件正在执行阶段。                    | 1,343.13     | 否            | 已判决          | 法院已判决被告履行还款责任。   | 公司已向法院申请强制执行。   | 2017 年 4 月 18 日 | 国元证券股份有限公司 2016 年年度报告 |
| 黄洪波诉张鹏、张亚宁、珠海金湾南翔路证券营业部民间借贷纠纷：本案的背景情况请参见本公司 2016 年年度报告。2017 年 5 月，珠海市金湾区人民法院开庭审理本案。                           | 412.80       | 否            | 法院审理中，尚未作出判决 | 不适用  | 不适用   | 2017 年 4 月 18 日 | 国元证券股份有限公司 2016 年年度报告 |
| 国元创新投资有限公司诉安徽华安达集团工艺品有限公司、霍邱县城镇建设投资有限公司合同纠纷：国元创新投系本公司控股子公司，本案的背景情况参加本公司 2016 年年度报告。                           | 404.12       | 否            | 已判决          | 2017 年 1 月 6 日，国元创新投收到合肥市包河区人民法院民事判决书，判决华安达集团支付借款本金及违约金、 | 2017 年 1 月 19 日，创新投公司收到霍邱城投支付判决款项 3972006.18 元，至此本案已了结。 | 2017 年 4 月 18 日 | 国元证券股份有限公司 2016 年年度报告 |
| 李映东与公司证券期货交易纠纷：本案的背景情况请参见本公司 2016 年年度报告。  | 2,661.71     | 是            | 仲裁委审理中，尚未裁决  | 不适用  | 不适用   | 2017 年 4 月 18 日 | 国元证券股份有限公司 2016 年年度报告 |



## 九、处罚及整改情况

适用  不适用

公司报告期不存在处罚及整改情况。

## 十、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

适用  不适用

报告期内，公司及第一大股东国元集团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。

## 十一、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

适用  不适用

2016年3月13日，公司完成为维护资本市场稳定而实施的股票回购；2016年7月6日，安徽省国资委同意公司已回购股票用于员工持股计划；2016年8月3日、19日，公司董事会和股东大会分别审议通过《关于〈公司员工持股计划（二次修订稿）〉的议案》；2016年8月26日，公司按照相关规定完成了员工持股计划的股票过户手续。公司员工持股计划分为两期，其中，第一期员工持股计划证券账户持有公司股票为22,560,963股，占公司股本总额的比例为1.1487%，参与人数共1,521人，锁定期为12个月；第二期员工持股计划证券账户持有公司股票为7,000,521股，占公司股本总额的比例为0.3564%，参与人数共255人，锁定期为36个月。公司员工持股计划具体公告见2016年8月30日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网。

## 十二、重大关联交易

### 1、与日常经营相关的关联交易

适用  不适用

公司报告期未发生与日常经营相关的重大关联交易。

### 2、资产或股权收购、出售发生的关联交易

适用  不适用

公司报告期未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

### 3、共同对外投资的关联交易

适用  不适用

公司报告期未发生共同对外投资的关联交易。

#### (4) 关联债权债务往来

适用  不适用

公司报告期不存在关联债权债务往来。

#### (5) 其他重大关联交易

适用  不适用

公司报告期无其他重大关联交易。

公司关联交易具体情况见公司 2017 年半年度财务报表附注十。

### 十三、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

适用  不适用

公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金。

### 十四、重大合同及其履行情况

#### 1、托管、承包、租赁事项情况

##### (1) 托管情况

适用  不适用

公司报告期不存在托管情况。

##### (2) 承包情况

适用  不适用

公司报告期不存在承包情况。

##### (3) 租赁情况

适用  不适用

公司报告期不存在租赁情况。

## 2、重大担保

适用  不适用

公司报告期不存在担保情况。

## 3、其他重大合同

适用  不适用

公司报告期不存在其他重大合同。

# 十五、社会责任情况

## 1、履行精准扶贫社会责任情况

### (1) 半年度精准扶贫概要

**1、对接帮扶贫困县。**为积极配合国家扶贫攻坚战略，今年5月和6月，公司分别与寿县、太湖县签署了2017年《对口帮扶备忘录》。根据备忘录精神，公司将在2016年的捐赠和帮扶基础上，再向寿县捐款200万元、向太湖县捐款400万元，主要用于贫困村的光伏电站建设以及因学、因病致贫的特殊贫困家庭的资助等，在多层次资本市场建设、产业扶贫、教育扶贫、人才培养、农副产品销售、营业网点设立等方面与当地加强合作，并依托当地营业网点设立金融扶贫工作站。

**2、选派干部驻村帮扶。**根据省委组织部、省扶贫办关于进一步加强省直和中央驻皖单位选派帮扶干部工作的通知要求，公司选派了宿州汴河路营业部副总经理孙巩固作为集团公司扶贫工作队队长（第一书记），到灵璧县杨疃镇一里王村任职，积极帮助一里王村做好精准扶贫和精准脱贫工作。

**3、高校捐资助学。**公司从2016年起每年拿出620万元在黄山学院、铜陵学院、淮北师范大学等16所高校设立“金融实践教育奖学金”，在中国科技大学、合肥工业大学、安徽财经大学等10所高校设立“国元证券奖助学金”，重点资助和奖励贫困大学生，帮助他们顺利完成学业，阻断贫困的代际传递。目前，2017年度的金融实践教育奖学金、国元证券奖助学金资助活动正在推进，并已完成对安徽大学、安徽工程大学、亳州学院等高校的捐赠。

**4、“雪莲花爱心基金”常态化献爱心。**6月初，公司投行总部“雪莲花爱心基金”走进宁夏吴忠市红寺堡区大河乡大河中心小学、中宁县大战场镇花豹湾村花豹湾上渠完小学，向贫困学生送去了20万元的学习用品，使红寺堡区772名贫困学生得到了帮助；在花豹湾上渠完小学建立“爱心小屋”，让144名学

生受益。投行总部于2012年年初成立“雪莲花爱心基金”至今，已累计向西藏、新疆等地区捐款6次，累计捐款超过130万元。

### (2) 上市公司半年度精准扶贫工作情况

| 指标             | 计量单位 | 数量/开展情况 |
|----------------|------|---------|
| 一、总体情况         | ---  | ---     |
| 其中：资金          | 万元   | 520     |
| 帮助建档立卡贫困人口脱贫数  | 人    | 1,445   |
| 二、分项投入         | ---  | ---     |
| 1. 产业发展脱贫      | ---  | ---     |
| 其中： 产业发展脱贫项目个数 | 个    | 12      |
| 产业发展脱贫项目投入金额   | 万元   | 330     |
| 帮助建档立卡贫困人口脱贫数  | 人    | 1,100   |
| 2. 转移就业脱贫      | ---  | ---     |
| 3. 易地搬迁脱贫      | ---  | ---     |
| 4. 教育脱贫        | ---  | ---     |
| 其中： 资助贫困学生投入金额 | 万元   | 66.25   |
| 资助贫困学生人数       | 人    | 184     |
| 5. 健康扶贫        | ---  | ---     |
| 6. 生态保护扶贫      | ---  | ---     |
| 7. 兜底保障        | ---  | ---     |
| 其中 贫困残疾人投入金额   | 万元   | 20      |
| 帮助贫困残疾人数       | 人    | 100     |
| 8. 社会扶贫        | ---  | ---     |
| 9. 其他项目        | ---  | ---     |
| 其中： 投入金额       | 万元   | 103.75  |
| 帮助建档立卡贫困人口脱贫数  | 人    | 345     |
| 三、所获奖项（内容、级别）  | ---  | ---     |

### (3) 后续精准扶贫计划

2017年下半年，公司将在此前已经开展的各项扶贫工作和已取得的成果基础上，重点做好以下扶贫工作：

一是积极做好贫困县的对口帮扶。积极为太湖县、寿县企业上市融资、并购重组、新三板挂牌等提供服务；根据两县政府的规划安排，组织专业力量提供金融及产业发展政策规划、基础设施投融资、企业改制、金融创新等方面的财务顾问服务；为两县贫困大学生优先提供假期培训、实习机会和帮扶资助；在两县组织开展资本市场培训、宣传等工作，支持两县选派干部、企业高管到公司相关单位进行短期学习培训；继续帮助两县建设光伏电站，实施光伏扶贫；继续对两县因病、因学致贫的家庭予以资助；继续实施农产品消费扶贫。

二是指导、支持挂职干部做好精准帮扶工作。指导、支持到新疆和田地区挂职的武军、到宿州灵璧县挂职的孙巩固等人积极利用公司资源做好对当地的精准扶贫和精准脱贫工作。

三是继续做好助学扶贫。进一步做好“国元证券金融实践教育奖学金”、“国元证券奖助学金”的捐赠和赠后管理；继续做好针对中小学以及留守儿童的关爱工作。

四是继续做好其他领域的精准扶贫工作。

公司将积极争取各类帮扶项目和资金，加强与相关部门的对接协调，引导扶贫资源、资金向贫困村、贫困户聚集；全面整合现有各渠道的项目、资金、技术等资源，建立政府引导、贫困县主导、公司参与的多元化投入机制；优化公司扶贫组织结构，保证精准扶贫工作有效开展；把精准帮扶与基层组织建设紧密结合起来，协助当地加强以党支部为核心的基层组组建设，让基层组织建设成为发展生产、减贫摘帽的主力军。

## 2、重大环保情况

上市公司及其子公司是否属于环境保护部门公布的重点排污单位

否

## 十六、各单项业务资格的变化情况

适用  不适用

## 十七、其他重大事项的说明

适用  不适用

### 1、非公开发行进展情况

2017年2月23日，公司第八届董事会第三次会议审议通过了《关于调整公司非公开发行股票方案的议案》、《关于非公开发行A股股票预案（二次修订稿）的议案》等议案，具体公告见2017年2月24日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网。2017年4月26日，中国证监会发行审

核委员会对公司的非公开发行股票申请事宜进行了审核。根据审核结果，公司本次非公开发行股票申请获得通过。2017 年 5 月 24 日，公司披露了《关于实施 2016 年年度利润分配方案后调整非公开发行股票发行价格和发行数量的公告》，本次非公开发行股票的发行价格调整为人民币 9.25 元/股，本次非公开发行股票发行数量调整为不超过 455,560,578 股（含本数）。2017 年 7 月 11 日、27 日，公司第八届董事会第八次会议和 2017 年第二次临时股东大会审议通过《关于延长公司非公开发行 A 股股票股东大会决议有效期的议案》、《关于提请股东大会延长授权董事会办理本次非公开发行股票相关事宜的议案》等议案，具体公告见 2017 年 7 月 12 日和 2017 年 7 月 28 日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网。

## 2、债券发行进展情况

2017 年 1 月 25 日、2 月 13 日，公司第八届董事会第二次会议和 2017 年第一次临时股东大会审议通过《关于发行证券公司次级债的议案》、《关于公开发行公司债的议案》等议案，具体公告见 2017 年 1 月 26 日和 2017 年 2 月 14 日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网。2017 年 5 月 24 日，公司取得深交所《关于国元证券股份有限公司 2017 年证券公司次级债券符合深交所转让条件的无异议函》（深证函（2017）232 号）。根据该函，深交所对公司申请确认发行额度不超过 80 亿元人民币的国元证券股份有限公司 2017 年证券公司次级债券符合深交所转让条件无异议。该无异议函自出具之日起十二个月内有效。

3、2017 年 8 月 14 日，中国证监会公布了 2017 年证券公司分类结果，公司的分类结果为 A 类 A 级。

## 4、行政许可情况

2017 年 2 月 15 日，公司取得中国证监会安徽监管局《关于核准刘锦峰证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》（皖证监函〔2017〕49 号）。2017 年 2 月 23 日，公司第八届董事会第三次会议审议通过《关于聘任公司董事会秘书的议案》，同意聘任刘锦峰女士为公司董事会秘书，任期从本次董事会决议生效后至第八届董事会届满之日止。

## 5、公司重大事项信息披露索引

### （1）报告期内公司重大事项

| 事项  | 信息披露查询索引  | 披露日期      |
|---|---|-----------|
| 2016 年 12 月经营情况；2016 年年度业绩快报              | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/1/11 |
| 第八届董事会第二次会议决议公告；关于召开 2017 年第一次临时股东大会的通知   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/1/26 |
| 2017 年 1 月经营情况；关于召开 2017 年第一次临时股东大会的提示性公告 | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/2/8  |
| 2017 年第一次临时股东大会决议公告；2017 年第一次临时股东大会的法律意见  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/2/14 |

|   |   |           |
|---|---|-----------|
| 第八届董事会第三次会议决议公告；关于调整非公开发行股票方案的公告；关于非公开发行股票预案修订情况说明的公告；关于公司与嘉华优势（天津）投资企业（有限合伙）解除附条件生效的普通股认购协议及补充协议的公告；非公开发行 A 股股票预案（二次修订稿）；本次非公开发行 A 股股票募集资金使用可行性报告（修订稿）；关于非公开发行股票摊薄即期回报及填补措施的说明（修订稿）；独立董事关于公司非公开发行股票方案调整相关事项的事前认可意见；独立董事关于调整公司非公开发行股票相关事项的专项意见；关于取得发明专利证书的公告  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/2/24 |
| 2017 年 2 月经营情况  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/3/7  |
| 第八届董事会第四次会议决议公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/3/8  |
| 第八届董事会第五次会议决议公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/3/24 |
| 关于取得发明专利证书的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/3/28 |
| 关于收到《中国证监会行政许可申请中止审查通知书》的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/4/7  |
| 2017 年 3 月经营情况；2017 年第一季度业绩快报   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/4/12 |
| 第八届董事会第六次会议决议公告；关于召开 2016 年度股东大会的通知；2016 年年度报告摘要；2017 年第一季度报告正文；第八届监事会第二次会议决议公告；2016 年年度报告；2017 年第一季度报告全文；2016 年度董事会工作报告；2016 年度监事会工作报告；监事会对公司 2016 年度内部控制评价报告出具的审核意见；2016 年度监事薪酬及考核情况专项说明；2016 年度高级管理人员薪酬和考核情况专项说明；2016 年度董事薪酬和考核情况专项说明；2016 年度风险控制指标报告；2016 年社会责任报告；2016 年度内部控制评价报告；内部控制审计报告；2016 年年度审计报告；控股股东及其他关联方占用资金情况的专项审计说明；独立董事 2016 年度述职报告（喻荣虎）；独立董事 2016 年度述职报告（周世虹）；独立董事 2016 年度述职报告（杨棉之）；独立董事 2016 年度述职报告（鲁炜）；独立董事 2016 年度述职报告（任明川）；独立董事关于公司 2016 年度利润分配预案的独立意见；独立董事关于公司续聘 2017 年度审计机构发表的独立意见；独立董事关于对公司内部控制评价报告的意见；独立董事关于控股股东及其他关联方占用公司资金、公司对外担保情况的专项说明和独立意见 | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/4/18 |
| 关于收到《中国证监会行政许可申请恢复审查通知书》的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/4/22 |
| 关于非公开发行股票申请获中国证券监督管理委员会发行审核委员会审核通过的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/4/27 |
| 2017 年 4 月经营情况  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/5/6  |
| 2016 年度股东大会决议公告；2016 年度股东大会的法律意见  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/5/9  |
| 2016 年年度权益分派实施公告  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/5/16 |
| 关于实施 2016 年年度利润分配方案后调整非公开发行股票发行价格和发行数量的公告；关于发行短期融资券获得中国人民银行备案通知的公告  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/5/24 |

|   |   |           |
|---|---|-----------|
| 关于取得发明专利证书的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/3  |
| 关于公司债券“13 国元 01”和“13 国元 02”跟踪评级结果的公告；公司债券 2017 年跟踪评级报告      | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/6  |
| 2017 年 5 月经营情况  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/7  |
| 关于公司 2017 年度第一期短期融资券发行结果的公告                                 | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/16 |
| 第八届董事会第七次会议决议公告；风险控制指标管理办法（2017 年 6 月）；全面风险管理制度（2017 年 6 月） | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/17 |
| 公开发行 2013 年公司债券受托管理事务报告（2016 年度）                            | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/6/21 |

## （2）报告期末至本报告披露日公司重大事项

| 事项  | 信息披露查询索引  | 披露日期      |
|---|---|-----------|
| 2017 年半年度业绩快报；2017 年 6 月经营情况  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/7/11 |
| 关于召开 2017 年第二次临时股东大会的通知；第八届董事会第八次会议决议公告；第八届监事会第三次会议决议公告；关于延长非公开发行股票方案决议有效期及股东大会对董事会授权有效期的公告；公司章程及相关制度修订说明；独立董事关于延长非公开发行股票方案决议有效期及股东大会对董事会授权有效期的独立意见；独立董事关于延长非公开发行股票方案决议有效期及股东大会对董事会授权有效期的事前认可意见；子公司管理办法（2017 年 7 月）；募集资金管理制度（2017 年 7 月）；总裁工作细则（2017 年 7 月） | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/7/12 |
| 2013 年公司债券 2017 年付息公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/7/17 |
| 2017 年第二次临时股东大会决议公告；2017 年第二次临时股东大会的法律意见；公司章程（2017 年 7 月）；监事会议事规则（2017 年 7 月）；董事会议事规则（2017 年 7 月）   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/7/28 |
| 关于获准设立 13 家分支机构的公告  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/8/2  |
| 2017 年 7 月经营情况  | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/8/5  |
| 关于 2017 年度第二期短期融资券发行事宜的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/8/8  |
| 关于 2017 年度第二期短期融资券发行结果的公告   | 巨潮资讯网 <a href="http://www.cninfo.com.cn">http://www.cninfo.com.cn</a> | 2017/8/15 |

## 十八、公司子公司重大事项

√ 适用 □ 不适用

### 1、国元直投

2017 年上半年，国元直投根据中国证券业协会《证券公司私募投资基金子公司管理规范》的相关要求，申请转型为证券公司私募投资基金子公司，从事私募投资基金业务。据中国证券业协会 2017 年 4 月 7 日公告，国元直投为中国证券业协会第一批私募投资基金子公司会员。



2014年8月28日，公司第七届董事会第十三次会议审议通过了《关于全资子公司国元股权投资有限公司参股国元农村人寿保险有限公司（筹）的议案》，同意公司全资子公司国元股权投资有限公司与安徽国元控股（集团）有限公司及国元农业保险股份有限公司联合其他六家法人单位共同发起设立国元农村人寿保险股份有限公司（筹），具体公告见2014年8月29日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。截至报告期末，国元农村人寿保险股份有限公司（筹）的设立尚需经中国保监会批准，国元直投尚未出资。

## 2、国元创新

根据中国证券业协会2017年5月18日公告，国元创新为中国证券业协会第三批证券公司另类投资子公司会员。2017年5月24日，国元创新完成工商变更登记，经营范围由“项目投资，投资管理，投资信息咨询”变更为“项目投资，投资管理，投资信息咨询，股权投资（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）”。

## 3、国元香港

国元香港全资子公司国元证券经纪（香港）有限公司因在2010年9月至2012年7月期间未严格审查经纪业务客户资金流转（第三者资金存取交易），违反了相关监管条例要求，被香港证监会公开谴责并处以450万港元罚款。

## 4、国元期货

2017年8月10日，中国期货业协会公布了2017年期货公司分类评价结果，国元期货的分类评价为B类BBB级。

## 第六节 股份变动及股东情况

### 一、股份变动情况

#### 1、股份变动情况

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、国家持股     |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 2、国有法人持股   |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 3、其他内资持股   |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 其中：境内法人持股  |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 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、无限售条件股份  | 1,964,100,000 | 100% |             |    | 982,050,000 |    | 982,050,000 | 2,946,150,000 | 100% |
| 1、人民币普通股   | 1,964,100,000 | 100% |             |    | 982,050,000 |    | 982,050,000 | 2,946,150,000 | 100% |
| 2、境内上市的外资股 |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 3、境外上市的外资股 |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 4、其他       |               |      |             |    |             |    |             |               |      |
| 三、股份总数     | 1,964,100,000 | 100% |             |    | 982,050,000 |    | 982,050,000 | 2,946,150,000 | 100% |

股份变动的的原因

√ 适用 □ 不适用

2017年5月23日，公司实施了2016年度权益分派。公司2016年度权益分配方案为：以公司总股本1,964,100,000股为基数，向全体股东每10股派发现金股利人民币3元（含税）；同时以资本公积金向全体股东每10股转增5股。分红前公司总股本为1,964,100,000股，分红后，公司总股本增至2,946,150,000股。

股份变动的批准情况

√ 适用 □ 不适用

2017年4月17日，公司召开第八届董事会第六次会议，会议审议通过了《2016年度利润分配预案》，拟以2016年12月31日总股本1,964,100,000股为基数，向全体股东每10股派发现金股利人民币3元(含税)；同时以资本公积金向全体股东每10股转增5股，转增后总股本为2,946,150,000股。2017年5月8日，公司召开2016年度股东大会，会议审议通过《2016年度利润分配预案》。2017年5月23日，公司2016年度利润分派实施完毕。

股份变动的过户情况

适用  不适用

股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

适用  不适用

2017年5月23日，公司2016年度利润分派实施完毕，公司股本由1,964,100,000股增至2,946,150,000股，本次股份变动对2016年度和2017年上半年基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产指标影响如下：

| 指标                    | 2016年度/2016年12月31日 |        | 2017年上半年/2017年6月30日 |        |
|-----------------------|--------------------|--------|---------------------|--------|
|                       | 按原股本计算             | 按新股本计算 | 按原股本计算              | 按新股本计算 |
| 基本每股收益(元/股)           | 0.72               | 0.48   | 0.26                | 0.17   |
| 稀释每股收益(元/股)           | 0.72               | 0.48   | 0.26                | 0.17   |
| 归属于公司普通股股东的每股净资产(元/股) | 10.56              | 7.04   | 10.48               | 6.99   |

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

## 2、限售股份变动情况

适用  不适用

## 二、证券发行与上市情况

适用  不适用

## 三、公司股东数量及持股情况

单位：股

|             |         |                           |   |
|-------------|---------|---------------------------|---|
| 报告期末普通股股东总数 | 103,355 | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数<br>(如有) | 0 |
|-------------|---------|---------------------------|---|

## 持股 5%以上的股东或前 10 名股东持股情况

| 股东名称                             | 股东性质  | 持股比例 (%) | 报告期末持股数量    | 报告期内增减变动情况  | 持有有限售条件的股份数量 | 持有无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  | 21.99%   | 648,000,000 | 216,000,000 |              | 648,000,000  |         |            |
| 安徽国元信托有限责任公司                     | 国有法人  | 15.47%   | 455,707,462 | 151,902,487 |              | 455,707,462  |         |            |
| 安徽省粮油食品进出口(集团)公司                 | 国有法人  | 5.18%    | 152,645,598 | 43,881,866  |              | 152,645,598  | 质押      | 52,500,000 |
| 安徽省皖能股份有限公司                      | 国有法人  | 4.89%    | 144,049,200 | 48,016,400  |              | 144,049,200  |         |            |
| 安徽皖维高新材料股份有限公司                   | 国有法人  | 2.83%    | 83,283,853  | 22,308,484  |              | 83,283,853   |         |            |
| 安徽全柴集团有限公司                       | 国有法人  | 2.66%    | 78,345,000  | 28,695,000  |              | 78,345,000   |         |            |
| 安徽国海投资发展有限公司                     | 境内一般法人  | 2.20%    | 64,731,220  | 26,619,731  |              | 64,731,220   |         |            |
| 中央汇金资产管理有限责任公司                   | 国有法人  | 1.81%    | 53,432,850  | 17,810,950  |              | 53,432,850   |         |            |
| 中国证券金融股份有限公司                     | 境内一般法人  | 1.54%    | 45,298,889  | 15,951,629  |              | 45,298,889   |         |            |
| 国元证券股份有限公司第一期员工持股计划              | 基金、理财产品等  | 1.15%    | 33,841,444  | 11,280,481  |              | 33,841,444   |         |            |
| 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况(如有) | 无   |          |             |             |              |              |         |            |
| 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,未知其它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。 |          |             |             |              |              |         |            |

## 前 10 名无限售条件股东持股情况

| 股东名称             | 报告期末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 | 648,000,000     | 人民币普通股 | 648,000,000 |
| 安徽国元信托有限责任公司     | 455,707,462     | 人民币普通股 | 455,707,462 |
| 安徽省粮油食品进出口(集团)公司 | 152,645,598     | 人民币普通股 | 152,645,598 |
| 安徽省皖能股份有限公司      | 144,049,200     | 人民币普通股 | 144,049,200 |

|  |   |        |            |
|--|---|--------|------------|
| 安徽皖维高新材料股份有限公司                                     | 83,283,853  | 人民币普通股 | 83,283,853 |
| 安徽全柴集团有限公司   | 78,345,000  | 人民币普通股 | 78,345,000 |
| 安徽国海投资发展有限公司                                       | 64,731,220  | 人民币普通股 | 64,731,220 |
| 中央汇金资产管理有限责任公司                                     | 53,432,850  | 人民币普通股 | 53,432,850 |
| 中国证券金融股份有限公司                                       | 45,298,889  | 人民币普通股 | 45,298,889 |
| 国元证券股份有限公司—第1期员工持股计划                               | 33,841,444  | 人民币普通股 | 33,841,444 |
| 前10名无限售流通股股东之间，以及前10名无限售流通股股东和前10名股东之间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，未知其它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。 |        |            |
| 前10名普通股股东参与融资融券业务情况说明（如有）                          | 无   |        |            |

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

是  否

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

#### 四、控股股东或实际控制人变更情况

控股股东报告期内变更

适用  不适用

公司报告期控股股东未发生变更。

实际控制人报告期内变更

适用  不适用

公司报告期实际控制人未发生变更。

## 第七节 优先股相关情况

适用  不适用

报告期公司不存在优先股。

## 第八节 董事、监事、高级管理人员情况

### 一、董事、监事和高级管理人员持股变动

适用  不适用

公司董事、监事和高级管理人员在报告期持股情况没有发生变动，具体可参见 2016 年年报。

### 二、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 | 类型 | 日期              | 原因                             |
|-----|-------|----|-----------------|--------------------------------|
| 陈新  | 董事会秘书 | 任免 | 2017 年 2 月 23 日 | 因工作变动，陈新先生辞去公司董事会秘书职务，仍担任公司副总裁 |
| 刘锦峰 | 董事会秘书 | 聘任 | 2017 年 2 月 23 日 | 董事会聘任                          |

## 第九节 公司债相关情况

公司是否存在公开发行并在证券交易所上市，且在半年度报告批准报出日未到期或到期未能全额兑付的公司债券  
是

### 一、公司债券基本信息

| 债券名称   | 债券简称     | 债券代码  | 发行日             | 到期日             | 债券余额<br>(万元) | 利率   | 还本付息方式    |
|--|----------|---|-----------------|-----------------|--------------|------|-----------|
| 国元证券股份有限公司 2013 年公司债券                            | 13 国元 01 | 112186  | 2013 年 7 月 24 日 | 2018 年 7 月 24 日 | 327,000      | 4.7% | 按年付息，到期还本 |
| 国元证券股份有限公司 2013 年公司债券                            | 13 国元 02 | 112187  | 2013 年 7 月 24 日 | 2018 年 7 月 24 日 | 173,000      | 4.9% | 按年付息，到期还本 |
| 公司债券上市或转让的交易场所                                   |          | 深圳证券交易所   |                 |                 |              |      |           |
| 投资者适当性安排   |          | <p>2013年公司债券发行采取网上面向拥有合格A股证券账户的社会公众投资者公开发行和网下面向拥有合格A股证券账户的机构投资者询价配售相结合的方式，根据《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》第九条和《深圳证券交易所公司债券上市规则（2015年修订）》第2.2条规定，公众投资者和合格投资者均可参与认购与交易该债券；存续期间，本债券亦未发生《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》第十一条和《深圳证券交易所公司债券上市规则（2015年修订）》第2.3条所规定的公众投资者不得再买入的情形，公众投资者和合格投资者买入、卖出以及持有到期本债券均无相关限制，原投资者适当性安排继续适用。</p> <p>本债券一旦发生《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》第十一条和《深圳证券交易所公司债券上市规则（2015年修订）》第2.3条规定的情形，我司将及时提交相关事项的报告，向深交所提交债券投资者适当性安排调整公告并对外披露。</p> |                 |                 |              |      |           |
| 报告期内公司债券的付息兑付情况                                  |          | 本报告期未发生付息兑付情况。2017 年度付息日为 7 月 24 日（如遇法定节假日顺延）。  |                 |                 |              |      |           |
| 公司债券附发行人或投资者选择权条款、可交换条款等特殊条款的，报告期内相关条款的执行情况（如适用） |          | <p>“13 国元 01” 债券附有第 3 年末“发行人上调票面利率选择权”和“投资者回售选择权”。2016 年，我公司未上调票面利率，并分别于 2016 年 6 月 13 日、14 日及 15 日在巨潮资讯网发布了三次“关于‘13 国元 01’ 票面利率不调整和投资者回售实施办法的提示性公告”。根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的债券回售申报数据，“13 国元 01” 2016 年回售申报数量为 0 张、回售金额为 0 元（不含利息），剩余托管数量为 3,270 万张。</p>  |                 |                 |              |      |           |

### 二、债券受托管理人和资信评级机构信息

| 债券受托管理人： |              |      |                    |     |        |       |                       |
|----------|--------------|------|--------------------|-----|--------|-------|-----------------------|
| 名称       | 华泰联合证券有限责任公司 | 办公地址 | 深圳市福田区深南大道 4011 号香 | 联系人 | 张丹蕊、李想 | 联系人电话 | 010-56839484、56839368 |



|  |            |  |            |                               |  |  |
|--|------------|--|------------|-------------------------------|--|--|
|  |            |  | 港中旅大厦 25 层 |                               |  |  |
| 报告期内对公司债券进行跟踪评级的资信评级机构：                                  |            |  |            |                               |  |  |
| 名称   | 联合信用评级有限公司 |  | 办公地址       | 北京市朝阳区建国门外大街 2 号 PICC 大厦 12 层 |  |  |
| 报告期内公司聘请的债券受托管理人、资信评级机构发生变更的，变更的原因、履行的程序、对投资者利益的影响等（如适用） |            |  | 无变更        |                               |  |  |

### 三、公司债券募集资金使用情况

|                                 |   |
|---------------------------------|---|
| 公司债券募集资金使用情况及履行的程序              | 报告期内，发行人严格按照《国元证券股份有限公司公开发行 2013 年公司债券募集说明书》约定的募集资金用途使用募集资金，截至 2013 年 12 月 31 日，公司已将募集资金 497,400 万元（扣除发行费用后）全部用于补充公司营运资金。 |
| 期末余额（万元）                        | 0   |
| 募集资金专项账户运作情况                    | 不适用   |
| 募集资金使用是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致 | 是   |

### 四、公司债券信息评级情况

本报告期内，公司委托联合信用评级有限公司对本公司2013年发行的“13国元01”和“13国元02”公司债券进行了跟踪信用评级。联合信用评级有限公司出具了《国元证券股份有限公司公司债券2017年跟踪评级报告》（2017年6月6日在巨潮资讯网www.cninfo.com.cn公告），维持公司主体长期信用等级AAA，维持“13国元01”和“13国元02”公司债券信用等级均AAA，与上一年度定期跟踪评级结果相同。

### 五、公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施

#### （1）本债券发行时无担保、抵押以及其他增信机制

报告期内增信机制无变化；

#### （2）偿债计划

公司计划于存续期内每年支付利息，到期支付本金和最后一年的利息。公司将于2017年7月24日通过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司支付债券“13国元01”和“13国元02”于2016年7月24日至2017年7月23日期间的利息，合计总金额为23,846.00万元（含税），相关付息公告将在巨潮资讯网等公开媒体披露。

公司债券的本息支付主要以公司日常的盈利积累及经营活动所产生的现金流为保障。近三年，公司经营状况良好，资产规模持续增长，公司持续盈利。2014年、2015年、2016年以及2017年上半年，公司合并营业收入分别为34.86亿元、57.73亿元、33.76亿元和15.72亿元，净利润分别为13.72亿元、27.84亿元、

14.05亿元和5.14亿元。公司经营活动盈利可以保障公司债券的本息支付。

公司同时也建立了切实可行的偿债应急保障措施，包括变现公司持有的流动性资产、股权融资、采用多元化的融资渠道进行债务融资，以保证公司的偿债能力。公司总体综合实力较强，资信状况良好，外部融资渠道通畅。截至报告期末，公司已获得人民银行批复的同业拆借业务拆出、拆入上限为71亿元人民币；同时，公司还获得银行系统较大规模的授信额度。公司可以通过外部融资方式进一步增强公司的资金实力，保证相关债务的本息支付。

截至2017年6月30日，母公司流动性覆盖率（LCR）为303.20%，净稳定资金率（NSFR）为122.90%。优质流动性资产为66.50亿元，与母公司总资产403.85亿元（扣除代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款及代理承销证券款）的比率为16.47%。上述资产可作为公司应急保障公司债务偿付的资金来源。

### （3）偿债保障措施

本期债券制定充分的偿债保障措施，主要包括：（一）制定债券《持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、设立专门的偿付工作小组。报告期内，《债券持有会议规则》、受托管理人、偿付工作小组仍然有效，受托管理人华泰联合证券有限责任公司能够尽职履行职责；（二）提高盈利能力，优化资产负债结构。2017年上半年公司继续盈利，合并营业收入为15.72亿元，归属于母公司的净利润为5.14亿元，报告期末资产负债率（扣除代理买卖证券款和代理买卖承销款）为63.95%；（三）严格履行信息披露义务。公司一直恪守信息披露准则，公司信息披露连续十年被深交所评为A级；（四）强大股东背景。公司第一大股东国元集团是以金融业为主体的安徽省属国有独资大型投资控股类企业，2000年12月30日成立，注册资本30亿元人民币；（五）当出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息时，公司将至少采取如下措施，包括但不限于不向股东分配利润、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施、调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金、主要责任人不得调离等措施。

截至目前，本期债券尚不存在偿债风险。

## 六、报告期内债券持有人会议的召开情况

本报告期内未发生须召开债券持有人会议的事项，亦未召开债券持有人会议。

## 七、报告期内债券受托管理人履行职责的情况

报告期内，公司债券受托管理人——华泰联合证券有限责任公司按照约定履行了债券受托管理人的职责，持续关注发行人的经营状况和履约能力，督促发行人按照《募集说明书》约定支付利息和履行信息披露义务，保护债券持有人的合法权益。华泰联合证券有限责任公司在报告期内履行受托管理人职责时，与

发行人不存在债券募集说明书和受托管理协议中约定的利益冲突情形。

2017年6月，华泰联合证券有限责任公司出具了《国元证券股份有限公司2013年公司债券受托管理事务报告（2016年度）》（已于2017年6月21日披露在巨潮资讯网和深圳证券交易所网站），对公司债券概况、发行人2016年度经营和财务情况、募集资金使用情况、本期债券付息情况、债券持有人会议召开情况、本期债券跟踪评级情况、负责本次债券事务的专人变动情况、以及其他事项进行了客观说明，未发现报告期内公司有违规或异常情况影响本期债券持有人的合法权益的情形。

## 八、截至报告期末和上年末（或报告期和上年相同期间）公司的主要会计数据和财务指标

| 项目            | 本报告期末  | 上年末    | 本报告期末比上年末增减  |
|---------------|--------|--------|--------------|
| 流动比率          | 0.95   | 1.05   | -9.52%       |
| 资产负债率         | 63.95% | 62.16% | 增长 1.79 个百分点 |
| 速动比率          | 0.69   | 0.79   | -13.54%      |
|               | 本报告期   | 上年同期   | 本报告期比上年同期增减  |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.57   | 2.41   | 6.42%        |
| 贷款偿还率         | 100%   | 100%   | 0.00%        |
| 利息偿付率         | 100%   | 100%   | 0.00%        |

上述会计数据和财务指标同比变动超过30%的主要原因

适用  不适用

## 九、公司逾期未偿还债项

适用  不适用

公司不存在逾期未偿还债项。

## 十、报告期内对其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

报告期内付息兑付情况如下：

### （1）次级债

2017年5月27日，公司完成了“15国元01”35亿元次级债券2016年5月27日至2017年5月26日期间的利息支付工作。“15国元01”每手派息56.00元（含税），本期债券本次付息总金额为19,600.00万元（含税）。

### （2）短期融资券

2017年5月19日，中国人民银行向我公司下发了《关于核定国元证券股份有限公司短期融资券最高待偿还余额的通知》，核定我公司发行短期融资券待偿还余额最高不超过40亿元，并自通知银发之日起持续

有效。

2017年6月14日公司在银行间市场发行了“国元证券股份有限公司2017年度第一期短期融资券”（“17国元CP001”），发行规模20亿元，发行利率4.87%，期限为91天。截至2017年6月末，公司短期融资券情况如下：

| 简称        | 发行规模（亿元） | 发行利率  | 起息日期       | 兑付日期       | 计息天数 | 兑付情况 |
|-----------|----------|-------|------------|------------|------|------|
| 17国元CP001 | 20       | 4.87% | 2017年6月15日 | 2017年9月14日 | 91天  | 未兑付  |

### （3）收益凭证

报告期内，母公司共发行 296 期收益凭证，发行总量 32.36 亿元；共兑付 281 期产品（含 2015 和 2016 年发行的 66 期），兑付本息合计 63.12 亿元。截至报告期末，尚余 82 期（含 2016 年发行的 1 期）、本息合计 30.02 亿元收益凭证未到兑付期。详细情况如下：

| 类型   | 报告期内发行 |        | 报告期内兑付<br>(含 2015 和 2016 年发行的) |        | 报告期末未到期<br>(含 2016 年发行的) |        |
|------|--------|--------|--------------------------------|--------|--------------------------|--------|
|      | 期数     | 本金（亿元） | 期数                             | 本息（亿元） | 期数                       | 本息（亿元） |
| 零售   | 283    | 11.16  | 266                            | 10.96  | 68                       | 2.96   |
| 机构定制 | 13     | 21.2   | 15                             | 52.16  | 14                       | 27.06  |
| 合计   | 296    | 32.36  | 281                            | 63.12  | 82                       | 30.02  |

## 十一、报告期内获得的银行授信情况、使用情况以及偿还银行贷款的情况

截至报告期末，公司已获得人民银行批复的同业拆借业务拆出、拆入上限为71亿元人民币；共获得银行1,083亿元授信，已使用额度为140.57亿元，可用额度为942.43亿元。公司未向银行申请过贷款。

## 十二、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

报告期内，公司债券募集资金已按照募集说明书的约定全部用于补充公司营运资金；公司已严格按照募集说明书的约定及时足额向债券持有人支付债券利息；聘请联合信用评级有限公司进行跟踪评级，并披露了相关的跟踪评级报告；受托管理人华泰联合证券有限责任公司在规定时间内出具了《国元证券股份有限公司2013年公司债券受托管理事务报告（2016年度）》，履行了债券受托管理人职责；公司按照约定履行了相关的信息披露义务。

报告期内，公司不存在未按公司债券募集说明书相关约定或承诺执行的情况，未发生损害债券投资者利益的情形。

### 十三、报告期内发生的重大事项

报告期内，公司发生的重大事项见本报告第五节内容，报告期内公司不存在对经营情况和偿债能力产生重大不利影响的未披露事项。

### 十四、公司债券是否存在保证人

是  否

### 十五、次级债

#### 1、基本情况

2015 年 5 月 27 日，公司非公开发行了 35 亿元“国元证券股份有限公司 2015 年次级债券（第一期）”，债券简称“15 国元 01”，债券代码“118932”，发行规模为 35 亿元人民币，票面利率 5.6%，期限 3 年，本期债券转让交易场所为深圳证券交易所。

#### 2、债券受托管理人和资信评级机构信息

| 债券受托管理人：   |                   |      |                                  |                          |     |       |               |
|--|-------------------|------|----------------------------------|--------------------------|-----|-------|---------------|
| 名称   | 中信证券股份<br>有限公司    | 办公地址 | 广东省深圳市福田区中心三路 8<br>号卓越时代广场（二期）北座 | 联系人                      | 周伟帆 | 联系人电话 | 021-2026 2382 |
| 报告期内对公司债券进行跟踪评级的资信评级机构：  |                   |      |                                  |                          |     |       |               |
| 名称   | 上海新世纪资信评估投资服务有限公司 |      | 办公地址                             | 上海市黄浦区汉口路 398 号华盛大厦 14 层 |     |       |               |
| 报告期内公司聘请的债券受托管理人、资信<br>评级机构发生变更的，变更的原因、履行的<br>程序、对投资者利益的影响等（如适用） |                   |      | 无变更                              |                          |     |       |               |

#### 3、募集资金使用情况

本期债券设立了由受托管理人监管的偿债保障金专户和募集资金专户（同一账户），募集资金专户严格按照募集说明书约定和相关规定进行管理，并由受托管理人进行监督。报告期内，公司严格按照《国元证券股份有限公司非公开发行 2015 年次级债券募集说明书》约定的用途使用募集资金，未出现任何违反募集说明书约定或违反法律法规规定的情形。截至 2015 年 12 月 31 日，公司已将募集资金 350,000 万元全部用于补充公司营运资金。

报告期内，华普天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司管理层编制的《国元证券股份有限公司 2015 年次级债券（第一期）2016 年度募集资金存放与使用情况的专项报告》进行了专项审计，出具了《次级债券募集资金年度存放与使用情况鉴证报告》（会专字（2017）2623 号），认为公司管理层编制的《国元证券股份有限公司 2015 年次级债券（第一期）2016 年度募集资金存放与使用情况的专项报告》，符合中国

证监会《公司债券发行及交易管理办法》、深圳证券交易所《非公开发行公司债券业务管理暂行办法》和《关于进一步做好非公开发行公司债券信息披露相关工作的通知》的规定，在所有重大方面如实反映了“国元证券股份有限公司 2015 年次级债券（第一期）” 2016 年度募集资金实际存放与使用情况。

#### 4、信用评级情况及后续评级安排

本报告期内，公司委托上海新世纪资信评估投资服务有限公司对“15 国元 01”次级债券进行了跟踪信用评级。上海新世纪资信评估投资服务有限公司出具了《国元证券股份有限公司 2015 年次级债券跟踪评级报告》（已于 2017 年 6 月 13 日在深圳证券交易所网站（www.szse.cn）固定收益信息平台披露），维持公司主体长期信用等级 AAA，维持“15 国元 01”次级债券信用等级 AA+。

在公司发生可能影响上一次评级报告结论的重大事项时，上海新世纪资信评估投资服务有限公司将出具不定期跟踪评级报告并按规定及时披露。

#### 5、增信机制及其变化情况

本次债券无担保、无保证人、无抵押、无其它增信机制，报告期内无变化。

#### 6、债券本息兑付情况

2017 年 5 月 27 日，公司通过中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司支付次级债券“15 国元 01”于 2016 年 5 月 27 日至 2017 年 5 月 26 日期间的利息，合计总金额为 19,600.00 万元（含税），相关付息公告已在深交所网站固定收益信息平台进行披露。

#### 7、偿债保障措施执行情况及是否存在偿债风险

公司偿债资金主要来源于公司日常经营积累和经营活动所产生的现金流。近三年，公司经营状况良好，资产规模持续增长，公司持续盈利，公司经营活动盈利可以保障公司债券的本息支付。公司总体综合实力较强，资信状况良好，外部融资渠道通畅，获得银行系统大量的授信额度。截止目前，本期债券尚不存在偿债风险。

本期债券制定充分的偿债保障措施，主要包括：（一）制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、设立专门的偿付工作小组。报告期内，《债券持有会议规则》、受托管理人、偿付工作小组仍然有效，受托管理人中信证券股份有限公司能够尽职履行职责；（二）提高盈利能力，优化资产负债结构。2017 年上半年公司营业收入为 15.72 亿元，营业利润为 6.71 亿元；资产负债结构保持合理，半年末扣除代理买卖证券款后的资产负债率为 63.95%；（三）提高综合实力，保持优良资信。近些年通过外部融资和扩大业务规模，公司综合实力不断增强，同时严格的履行融资还款义务，在市场上保持着良好的信誉；（四）严格履行信息披露义务。公司信息披露连续十年被深交所评为 A 级；（五）强大的股东背景。公司第一大股东国元集团，是一家以金融业为主体的安徽省属国有独资大型投资控股类企业，资本实力雄厚，金融牌照齐全。近年来各项业务发展迅速，整体实力进一步增强；（六）设立募集资金和偿债保证金专户，并与

受托管理人、托管银行签订资金三方监管协议。在债券付息兑付前，按照规定将利息或本金存入偿债保证金专户。

当出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息时，公司将至少采取如下措施，包括但不限于：不向股东分配利润、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施、调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金、主要责任人不得调离等措施。

#### 8、报告期内债券持有人会议的召开情况

本报告期内未发生须召开次级债债券持有人会议的事项，未召开债券持有人会议。

#### 9、债券受托管理人履行受托管理职责情况

报告期内，“15 国元 01”受托管理人——中信证券股份有限公司按照约定履行了债券受托管理人的职责，持续关注发行人的经营状况和履约能力，督促发行人按照《募集说明书》约定支付利息和履行信息披露义务，保护债券持有人的合法权益。2017 年 6 月，中信证券股份有限公司出具了《国元证券股份有限公司 2015 年次级债券（第一期）债券受托管理人报告(2016 年度)》（已于 2016 年 6 月 22 日在深交所网站固定收益信息平台披露）。

此外，受托管理人在履行受托管理职责时，与发行人不存在利益冲突情况及相关的风险。

#### 10、重大诉讼事项及重大事项情况

报告期内，公司不存在涉及和可能涉及本公司的重大诉讼事项以及其他可能影响本期债券按期偿付的重大事项，其它重大事项见本报告第五节内容。

## 十六、短期公司债

### 1、发行基本情况

2016 年 8 月 25 日，公司非公开发行了“国元证券股份有限公司 2016 年证券公司短期公司债券（第一期）”（债券简称“国元 1601”、债券代码“117546”），发行规模为 30 亿元人民币，票面利率 3.09%，期限为 1 年，债券转让交易场所为深圳证券交易所。

### 2、债券受托管理人和资信评级机构信息

|  |                |      |                                  |     |     |       |              |
|--|----------------|------|----------------------------------|-----|-----|-------|--------------|
| 债券受托管理人：                                   |                |      |                                  |     |     |       |              |
| 名称   | 中信证券股份<br>有限公司 | 办公地址 | 广东省深圳市福田区中心三路 8<br>号卓越时代广场（二期）北座 | 联系人 | 宫海韵 | 联系人电话 | 010-60837472 |
| 报告期内对公司债券进行跟踪评级的资信评级机构：                    |                |      |                                  |     |     |       |              |
| 名称   | 无              |      | 办公地址                             | 无   |     |       |              |
| 报告期内公司聘请的债券受托管理人、资信<br>评级机构发生变更的，变更的原因、履行的 |                |      |                                  | 不适用 |     |       |              |

程序、对投资者利益的影响等（如适用）

### 3、募集资金使用情况

本期债券设立了由受托管理人监管的偿债保障金专户和募集资金专户（同一账户），募集资金专户严格按照募集说明书约定和相关规定进行管理，并由受托管理人进行监督。报告期内，公司严格按照《国元证券股份有限公司 2016 年证券公司短期公司债券（第一期）募集说明书》约定的用途使用募集资金，未出现任何违反募集说明书约定或违反法律法规规定的情形。截至 2016 年 12 月 31 日，公司已将募集资金 300,000 万元全部用于补充公司营运资金。

报告期内，华普天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司管理层编制的《国元证券股份有限公司 2016 年证券公司短期公司债券（第一期）2016 年度募集资金存放与使用情况的专项报告》进行了专项审计，出具了《公司债券募集资金年度存放与使用情况鉴证报告》（会专字（2017）20172622 号），认为公司管理层编制的《国元证券股份有限公司 2016 年证券公司短期公司债券（第一期）2016 年度募集资金存放与使用情况的专项报告》，符合中国证监会《公司债券发行及交易管理办法》、深圳证券交易所《非公开发行公司债券业务管理暂行办法》和《关于进一步做好非公开发行公司债券信息披露相关工作的通知》的规定，在所有重大方面如实反映了“国元证券股份有限公司 2016 年证券公司短期公司债券（第一期）” 2016 年度募集资金实际存放与使用情况。

### 4、信用评级机构、信用评级情况及后续评级安排

本次发行证券公司短期公司债券未进行信用评级，亦无后续评级跟踪安排。

### 5、增信机制及其变化情况

本次债券无担保、无保证人、无抵押、无其它增信机制，报告期内无变化。

### 6、债券本息兑付情况

本期债券为 1 年期，将于 2017 年 8 月 25 日一次性还本付息。本报告期内未进行付息兑付。

### 7、偿债保障措施执行情况及是否存在偿债风险

公司偿债资金主要来源于公司日常经营积累和经营活动所产生的现金流。近三年，公司经营状况良好，资产规模持续增长，公司持续盈利，公司经营活动盈利可以保障公司债券的本息支付。公司总体综合实力较强，资信状况良好，外部融资渠道通畅，获得银行系统大量的授信额度。截止目前，本期债券尚不存在偿债风险。

本期债券制定充分的偿债保障措施，主要包括：（一）设立专门的偿付工作小组，充分发挥受托管理人的作用。公司为本期债券制定了《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人。报告期内，《债券持有人会议规则》、受托管理人、偿付工作小组仍然有效，受托管理人中信证券股份有限公司能够尽职履行职责；（二）严格履行信息披露义务。公司一直恪守信息披露准则，公司信息披露连续十年被深交所评为 A



级；（三）强大的股东背景。公司第一大股东国元集团是以金融业为主体的安徽省属国有独资大型投资控股类企业，资本实力雄厚；（四）设立募集资金和偿债保证金专户，并与受托管理人、托管银行签订资金三方监管协议。在债券付息兑付前，按照规定将利息或本金存入偿债保证金专户。

当出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息时，公司将至少采取如下措施，包括但不限于：不向股东分配利润、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施、调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金、主要责任人不得调离等措施。

#### 8、报告期内债券持有人会议的召开情况

本报告期内未发生须召开次级债券持有人会议的事项，未召开债券持有人会议。

#### 9、债券受托管理人及其履职情况

报告期内，“国元 1601”受托管理人——中信证券股份有限公司按照约定履行了债券受托管理人的职责，持续关注发行人的经营状况和履约能力，督促发行人按照《募集说明书》约定支付利息和履行信息披露义务，保护债券持有人的合法权益。2017年6月，中信证券股份有限公司出具了《国元证券股份有限公司2016年证券公司短期公司债券（第一期）债券受托管理人报告（2016年度）》（已于2016年6月5日在深交所网站固定收益信息平台披露）。

此外，受托管理人在履行受托管理职责时，与发行人不存在利益冲突情况及相关的风险。

#### 10、重大诉讼事项及重大事项情况

报告期内，公司不存在涉及和可能涉及本公司的重大诉讼事项以及其他可能影响本期债券按期偿付的重大事项，其它重大事项见本报告第五节内容。

## 第十节 财务报告

### 一、审计报告

半年度报告是否经过审计

是  否

公司半年度财务报告未经审计。

### 二、财务报表及附注

财务附注中报表的单位为：人民币元

#### 财务报表（未经审计）

##### 1、合并资产负债表

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017年6月30日

单位：元

| 资产                     | 附注五 | 期末余额              | 年初余额              |
|------------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 资 产：                   |     |                   |                   |
| 货币资金                   | 1   | 16,716,084,200.51 | 18,091,790,597.18 |
| 其中：客户存款                |     | 12,630,583,556.56 | 13,671,958,823.18 |
| 结算备付金                  | 2   | 3,135,757,264.42  | 2,925,756,284.09  |
| 其中：客户备付金               |     | 2,759,169,456.98  | 2,654,535,649.17  |
| 拆出资金                   |     |                   |                   |
| 融出资金                   | 3   | 13,300,011,483.43 | 12,227,464,711.38 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4   | 1,290,128,720.17  | 1,312,644,232.54  |
| 衍生金融资产                 | 5   |                   |                   |
| 买入返售金融资产               | 6   | 7,842,495,088.25  | 6,351,501,872.10  |
| 应收款项                   | 7   | 380,566,829.62    | 653,505,903.26    |
| 应收利息                   | 8   | 877,665,722.94    | 746,583,068.27    |
| 存出保证金                  | 9   | 48,450,613.03     | 42,693,079.47     |
| 划分为持有待售的资产             |     |                   |                   |
| 可供出售金融资产               | 10  | 25,100,306,490.58 | 25,045,207,832.19 |

|             |    |                          |                          |
|-------------|----|--------------------------|--------------------------|
| 持有至到期投资     | 12 | 18,858,165.76            | 19,435,696.00            |
| 长期股权投资      | 13 | 2,118,899,405.35         | 2,094,747,875.63         |
| 投资性房地产      |    |                          |                          |
| 固定资产        | 14 | 1,402,009,185.85         | 1,430,567,270.23         |
| 在建工程        | 15 | 75,437,544.40            | 71,183,732.09            |
| 无形资产        | 16 | 37,418,105.16            | 37,257,253.69            |
| 商誉          | 17 | 122,706,581.19           | 122,706,581.19           |
| 递延所得税资产     | 18 | 122,134,373.17           | 160,620,050.37           |
| 其他资产        | 19 | 404,233,156.83           | 355,376,572.00           |
| <b>资产总计</b> |    | <b>72,993,162,930.66</b> | <b>71,689,042,611.68</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

### 合并资产负债表（续）

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017年6月30日

单位：元

| 负债和所有者权益（或股东权益）            | 附注五 | 期末余额              | 年初余额              |
|----------------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 负 债：                       |     |                   |                   |
| 短期借款                       | 21  | 1,219,427,600.00  | 975,005,000.00    |
| 应付短期融资款                    | 22  | 9,616,604,257.98  | 8,136,090,000.00  |
| 拆入资金                       |     |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金<br>融负债 | 23  | 11,372,270,008.52 | 9,896,296,729.50  |
| 衍生金融负债                     |     |                   |                   |
| 卖出回购金融资产款                  | 24  | 5,987,430,227.50  | 4,285,290,080.00  |
| 代理买卖证券款                    | 25  | 15,498,536,667.68 | 16,495,810,718.77 |
| 代理承销证券款                    |     |                   |                   |
| 应付职工薪酬                     | 26  | 305,909,845.51    | 398,469,269.22    |
| 应交税费                       | 27  | 95,917,125.75     | 239,516,744.76    |
| 应付款项                       | 28  | 528,047,582.87    | 169,685,886.28    |
| 应付利息                       | 29  | 370,689,698.65    | 462,116,746.70    |
| 划分为持有待售的负债                 |     |                   |                   |
| 预计负债                       | 30  | 5,592,088.55      | 5,592,088.55      |
| 长期借款                       |     |                   |                   |
| 应付债券                       | 31  | 7,017,186,506.05  | 9,492,261,596.14  |

|                          |    |                          |                          |
|--------------------------|----|--------------------------|--------------------------|
| 其中：优先股                   |    |                          |                          |
| 永续债                      |    |                          |                          |
| 递延收益                     |    |                          |                          |
| 递延所得税负债                  | 18 | 208,529,087.40           | 217,140,113.75           |
| 其他负债                     | 32 | 40,485,134.80            | 30,272,069.94            |
| <b>负债合计</b>              |    | <b>52,266,625,831.26</b> | <b>50,803,547,043.61</b> |
| 所有者权益（或股东权益）：            |    |                          |                          |
| 实收资本（或股本）                | 33 | 2,946,150,000.00         | 1,964,100,000.00         |
| 其他权益工具                   |    |                          |                          |
| 其中：优先股                   |    |                          |                          |
| 永续债                      |    |                          |                          |
| 资本公积                     | 34 | 8,853,032,591.38         | 9,835,082,591.38         |
| 减：库存股                    |    |                          |                          |
| 其他综合收益                   | 35 | 633,513,132.72           | 710,980,050.56           |
| 盈余公积                     | 36 | 1,178,846,019.19         | 1,178,846,019.19         |
| 一般风险准备                   | 37 | 2,376,434,660.46         | 2,376,434,660.46         |
| 未分配利润                    | 38 | 4,601,111,060.18         | 4,676,622,766.89         |
| 归属于母公司的所有者权益合计           |    | 20,589,087,463.93        | 20,742,066,088.48        |
| 少数股东权益                   | 39 | 137,449,635.47           | 143,429,479.59           |
| <b>所有者权益（或股东权益）合计</b>    |    | <b>20,726,537,099.40</b> | <b>20,885,495,568.07</b> |
| <b>负债和所有者权益（或股东权益）总计</b> |    | <b>72,993,162,930.66</b> | <b>71,689,042,611.68</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

## 2、母公司资产负债表

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017年6月30日

单位：元

| 资产       | 附注十五 | 期末余额              | 年初余额              |
|----------|------|-------------------|-------------------|
| 资 产：     |      |                   |                   |
| 货币资金     |      | 13,252,222,081.18 | 14,698,376,276.10 |
| 其中：客户存款  |      | 10,172,392,343.44 | 11,313,868,009.64 |
| 结算备付金    |      | 2,627,855,389.22  | 2,338,295,532.96  |
| 其中：客户备付金 |      | 2,336,800,589.90  | 2,133,710,154.36  |
| 拆出资金     |      |                   |                   |
| 融出资金     |      | 11,065,384,820.18 | 10,603,105,770.44 |

|                        |   |                          |                          |
|------------------------|---|--------------------------|--------------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |   | 769,018,498.48           | 676,426,542.98           |
| 衍生金融资产                 |   |                          |                          |
| 买入返售金融资产               |   | 7,246,339,092.25         | 5,905,993,762.10         |
| 应收款项                   |   | 293,954,267.75           | 411,761,632.10           |
| 应收利息                   |   | 369,996,521.74           | 325,145,681.70           |
| 存出保证金                  |   | 37,595,509.06            | 66,126,979.43            |
| 划分为持有待售的资产             |   |                          |                          |
| 可供出售金融资产               |   | 9,525,107,965.75         | 11,487,698,873.63        |
| 持有至到期投资                |   |                          |                          |
| 长期股权投资                 | 1 | 6,009,434,839.14         | 5,986,908,072.53         |
| 投资性房地产                 |   |                          |                          |
| 固定资产                   |   | 1,385,522,832.96         | 1,413,145,548.67         |
| 在建工程                   |   | 75,437,544.40            | 71,183,732.09            |
| 无形资产                   |   | 32,005,567.83            | 31,417,041.99            |
| 商誉                     |   |                          |                          |
| 递延所得税资产                |   | 101,022,406.80           | 120,988,963.69           |
| 其他资产                   |   | 60,768,125.29            | 244,717,044.04           |
| <b>资产总计</b>            |   | <b>52,851,665,462.03</b> | <b>54,381,291,454.45</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

### 母公司资产负债表（续）

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017 年 6 月 30 日

单位：元

| 负债和所有者权益（或股东权益）        | 附注十 | 期末余额              | 年初余额              |
|------------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 负 债：                   |     |                   |                   |
| 短期借款                   |     |                   |                   |
| 应付短期融资款                |     | 9,390,104,257.98  | 7,717,390,000.00  |
| 拆入资金                   |     |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |     |                   |                   |
| 衍生金融负债                 |     |                   |                   |
| 卖出回购金融资产款              |     | 3,332,132,227.50  | 2,615,310,080.00  |
| 代理买卖证券款                |     | 12,466,458,109.61 | 13,402,899,714.10 |
| 代理承销证券款                |     |                   |                   |

|                          |  |                          |                          |
|--------------------------|--|--------------------------|--------------------------|
| 应付职工薪酬                   |  | 295,867,053.16           | 367,744,042.98           |
| 应交税费                     |  | 84,233,049.68            | 142,848,198.18           |
| 应付款项                     |  | 74,266,758.18            | 77,272,611.29            |
| 应付利息                     |  | 363,282,648.48           | 455,874,594.83           |
| 划分为持有待售的负债               |  |                          |                          |
| 预计负债                     |  | 5,592,088.55             | 5,592,088.55             |
| 长期借款                     |  |                          |                          |
| 应付债券                     |  | 7,017,186,506.05         | 9,492,261,596.14         |
| 其中：优先股                   |  |                          |                          |
| 永续债                      |  |                          |                          |
| 递延收益                     |  |                          |                          |
| 递延所得税负债                  |  | 144,409,986.60           | 170,125,196.54           |
| 其他负债                     |  | 19,330,697.12            | 12,132,764.60            |
| <b>负债合计</b>              |  | <b>33,192,863,382.91</b> | <b>34,459,450,887.21</b> |
| 所有者权益（或股东权益）：            |  |                          |                          |
| 实收资本（或股本）                |  | 2,946,150,000.00         | 1,964,100,000.00         |
| 其他权益工具                   |  |                          |                          |
| 其中：优先股                   |  |                          |                          |
| 永续债                      |  |                          |                          |
| 资本公积                     |  | 8,852,944,832.88         | 9,834,994,832.88         |
| 减：库存股                    |  |                          |                          |
| 其他综合收益                   |  | 440,552,942.78           | 517,624,388.74           |
| 盈余公积                     |  | 1,178,846,019.19         | 1,178,846,019.19         |
| 一般风险准备                   |  | 2,306,639,383.74         | 2,306,639,383.74         |
| 未分配利润                    |  | 3,933,668,900.53         | 4,119,635,942.69         |
| <b>所有者权益（或股东权益）合计</b>    |  | <b>19,658,802,079.12</b> | <b>19,921,840,567.24</b> |
| <b>负债和所有者权益（或股东权益）总计</b> |  | <b>52,851,665,462.03</b> | <b>54,381,291,454.45</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

### 3、合并利润表

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目        | 附注五 | 本期金额             | 上期金额             |
|-----------|-----|------------------|------------------|
| 一、营业收入    |     | 1,571,612,017.32 | 1,402,827,242.31 |
| 手续费及佣金净收入 | 40  | 587,342,144.40   | 723,210,205.19   |

|                                     |    |                 |                 |
|-------------------------------------|----|-----------------|-----------------|
| 其中：经纪业务手续费净收入                       | 40 | 360,964,321.08  | 511,618,075.21  |
| 投资银行业务手续费净收入                        | 40 | 184,354,787.65  | 179,095,066.96  |
| 资产管理业务手续费净收入                        | 40 | 30,145,128.05   | 19,924,204.29   |
| 利息净收入                               | 41 | 452,979,607.74  | 378,400,551.34  |
| 投资收益（损失以“-”号填列）                     | 42 | 856,010,681.03  | 567,957,501.63  |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益                  |    | 38,917,223.32   | 30,316,360.23   |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）                 | 43 | -344,153,519.63 | -282,371,940.02 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）                     |    | 5,002,563.26    | 8,070,832.26    |
| 其他业务收入                              | 44 | 14,430,540.52   | 7,560,091.91    |
| 二、营业支出                              |    | 900,979,422.13  | 800,997,190.85  |
| 税金及附加                               | 45 | 16,164,407.63   | 66,638,821.21   |
| 业务及管理费                              | 46 | 892,219,914.55  | 745,912,412.87  |
| 资产减值损失                              | 47 | -11,501,359.31  | -13,169,970.57  |
| 其他业务成本                              | 48 | 4,096,459.26    | 1,615,927.34    |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列）                   |    | 670,632,595.19  | 601,830,051.46  |
| 加：营业外收入                             | 49 | 6,248,913.86    | 14,219,793.55   |
| 其中：非流动资产处置利得                        |    | 235,199.66      | 112,803.10      |
| 减：营业外支出                             | 50 | 5,525,267.42    | 3,840,865.84    |
| 其中：非流动资产处置损失                        |    | 74,495.26       | 202,442.56      |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）                 |    | 671,356,241.63  | 612,208,979.17  |
| 减：所得税费用                             | 51 | 153,667,586.58  | 98,462,885.26   |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列）                   |    | 517,688,655.05  | 513,746,093.91  |
| 归属于母公司所有者（或股东）的净利润                  |    | 513,718,293.29  | 510,562,083.71  |
| 少数股东损益                              |    | 3,970,361.76    | 3,184,010.20    |
| 六、其他综合收益的税后净额                       |    | -77,417,123.72  | 31,765,699.13   |
| 归属母公司所有者（或股东）的其他综合收益的税后净额           |    | -77,466,917.84  | 31,766,199.47   |
| （一）以后不能重分类进损益的其他综合收益                |    |                 |                 |
| 1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动             |    |                 |                 |
| 2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额  |    |                 |                 |
| （二）以后将重分类进损益的其他综合收益                 |    | -77,466,917.84  | 31,766,199.47   |
| 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 |    | 4,094,306.40    | -2,540,171.15   |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 |    | -44,653,274.21  | 12,086,116.31   |

|                          |      |                |                |
|--------------------------|------|----------------|----------------|
| 3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益 |      |                |                |
| 4. 现金流量套期损益的有效部分         |      |                |                |
| 5. 外币财务报表折算差额            |      | -36,907,950.03 | 22,220,254.31  |
| 6. 其他                    |      |                |                |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额      |      | 49,794.12      | -500.34        |
| 七、综合收益总额                 |      | 440,271,531.33 | 545,511,793.04 |
| 归属于母公司所有者（或股东）的综合收益总额    |      | 436,251,375.45 | 542,328,283.18 |
| 归属于少数股东的综合收益总额           |      | 4,020,155.88   | 3,183,509.86   |
| 八、每股收益：                  |      |                | -              |
| （一）基本每股收益                | 十六、2 | 0.17           | 0.18           |
| （二）稀释每股收益                | 十六、2 | 0.17           | 0.18           |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

#### 4、母公司利润表

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                  | 附注十五 | 本期金额             | 上期金额             |
|---------------------|------|------------------|------------------|
| 一、营业收入              |      | 1,318,410,070.05 | 1,205,181,681.89 |
| 手续费及佣金净收入           | 2    | 560,435,279.29   | 691,565,647.40   |
| 其中：经纪业务手续费净收入       |      | 325,079,002.17   | 483,156,937.05   |
| 投资银行业务手续费净收入        |      | 182,569,611.39   | 178,063,281.46   |
| 资产管理业务手续费净收入        |      | 50,634,361.55    | 24,384,938.38    |
| 利息净收入               |      | 422,776,282.70   | 331,918,198.96   |
| 投资收益（损失以“-”号填列）     | 3    | 325,126,819.66   | 203,209,003.80   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益  |      | 37,292,460.21    | 30,316,360.23    |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |      | 2,795,583.27     | -28,222,163.17   |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |      | -515,935.53      | 357,924.19       |
| 其他业务收入              |      | 7,792,040.66     | 6,353,070.71     |
| 二、营业支出              |      | 793,091,789.63   | 724,762,169.79   |
| 税金及附加               |      | 15,805,253.05    | 64,972,519.01    |
| 业务及管理费              |      | 782,661,295.10   | 671,243,784.19   |
| 资产减值损失              |      | -9,471,217.78    | -13,070,060.75   |
| 其他业务成本              |      | 4,096,459.26     | 1,615,927.34     |



|                                     |  |                |                |
|-------------------------------------|--|----------------|----------------|
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列）                   |  | 525,318,280.42 | 480,419,512.10 |
| 加：营业外收入                             |  | 3,086,789.80   | 6,064,578.06   |
| 其中：非流动资产处置利得                        |  | 235,199.66     | 112,803.10     |
| 减：营业外支出                             |  | 5,520,349.57   | 3,829,521.03   |
| 其中：非流动资产处置损失                        |  | 73,323.26      | 196,377.51     |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）                 |  | 522,884,720.65 | 482,654,569.13 |
| 减：所得税费用                             |  | 119,621,762.81 | 70,901,571.96  |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列）                   |  | 403,262,957.84 | 411,752,997.17 |
| 六、其他综合收益的税后净额                       |  | -77,071,445.96 | -19,381,843.56 |
| （一）以后不能重分类进损益的其他综合收益                |  |                |                |
| 1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动             |  |                |                |
| 2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额  |  |                |                |
| （二）以后将重分类进损益的其他综合收益                 |  | -77,071,445.96 | -19,381,843.56 |
| 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 |  | 4,094,306.40   | -2,540,171.15  |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 |  | -81,165,752.36 | -16,841,672.41 |
| 3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益            |  |                |                |
| 4. 现金流量套期损益的有效部分                    |  |                |                |
| 5. 外币财务报表折算差额                       |  | -              | -              |
| 6. 其他                               |  |                |                |
| 七、综合收益总额                            |  | 326,191,511.88 | 392,371,153.61 |
| 八、每股收益                              |  |                |                |
| （一）基本每股收益                           |  | 0.14           | 0.14           |
| （二）稀释每股收益                           |  | 0.14           | 0.14           |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

## 5、合并现金流量表

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                           | 附注五 | 本期金额             | 上期金额 |
|------------------------------|-----|------------------|------|
| 一、经营活动产生的现金流量：               |     |                  |      |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额 |     | 1,787,797,131.60 |      |

|                            |        |                         |                          |
|----------------------------|--------|-------------------------|--------------------------|
| 收取利息、手续费及佣金的现金             |        | 1,749,898,616.55        | 1,741,187,516.52         |
| 拆入资金净增加额                   |        |                         |                          |
| 回购业务资金净增加额                 |        | 198,982,837.94          |                          |
| 融出资金净减少额                   |        |                         | 4,369,782,027.31         |
| 代理买卖证券收到的现金净额              |        |                         |                          |
| 收到其他与经营活动有关的现金             | 52 (1) | 593,835,085.28          | 195,461,152.03           |
| 经营活动现金流入小计                 |        | <b>4,330,513,671.37</b> | <b>6,306,430,695.86</b>  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产支付净额 |        |                         | 29,608,123.70            |
| 支付利息、手续费及佣金的现金             |        | 305,063,157.63          | 283,970,239.94           |
| 拆入资金净减少额                   |        |                         |                          |
| 回购业务资金净减少额                 |        |                         | 3,458,408,025.86         |
| 融出资金净增加额                   |        | 1,074,869,782.36        |                          |
| 代理买卖证券支付的现金净额              |        | 997,274,051.09          | 2,742,922,767.61         |
| 支付给职工以及为职工支付的现金            |        | 744,127,002.65          | 744,821,844.83           |
| 支付的各项税费                    |        | 327,053,365.02          | 355,131,130.11           |
| 支付其他与经营活动有关的现金             | 52 (2) | 155,934,285.44          | 168,109,074.27           |
| 经营活动现金流出小计                 |        | <b>3,604,321,644.19</b> | <b>7,782,971,206.32</b>  |
| 经营活动产生的现金流量净额              |        | <b>726,192,027.18</b>   | <b>-1,476,540,510.46</b> |
| 二、投资活动产生的现金流量：             |        |                         |                          |
| 收回投资所收到的现金                 |        |                         |                          |
| 取得投资收益收到的现金                |        | 18,860,000.00           | 30,996,000.00            |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额        |        |                         |                          |
| 收到其他与投资活动有关的现金             | 52 (3) | 1,761,460.73            | 241,418.31               |
| 投资活动现金流入小计                 |        | <b>20,621,460.73</b>    | <b>31,237,418.31</b>     |
| 投资支付的现金                    |        |                         | 866,670,000.00           |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现    |        | 44,827,900.47           | 47,010,565.31            |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额        |        |                         |                          |
| 支付其他与投资活动有关的现金             |        |                         |                          |
| 投资活动现金流出小计                 |        | <b>44,827,900.47</b>    | <b>913,680,565.31</b>    |
| 投资活动产生的现金流量净额              |        | <b>-24,206,439.74</b>   | <b>-882,443,147.00</b>   |
| 三、筹资活动产生的现金流量：             |        |                         |                          |
| 吸收投资收到的现金                  |        |                         |                          |
| 其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金        |        |                         |                          |
| 取得借款收到的现金                  |        | 244,422,600.00          | 7,454,670.00             |
| 发行债券收到的现金                  |        | 5,236,180,000.00        | 2,125,610,000.00         |

|                    |        |                          |                          |
|--------------------|--------|--------------------------|--------------------------|
| 收到其他与筹资活动有关的现金     |        |                          |                          |
| 筹资活动现金流入小计         |        | <b>5,480,602,600.00</b>  | <b>2,133,064,670.00</b>  |
| 偿还债务支付的现金          |        | 6,233,490,000.00         | 4,500,930,000.00         |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金  |        | 1,083,153,666.54         | 255,179,618.65           |
| 其中：子公司付给少数股东的股利、利润 |        | 10,000,000.00            |                          |
| 支付其他与筹资活动有关的现金     | 52 (4) |                          | 399,110,881.54           |
| 筹资活动现金流出小计         |        | <b>7,316,643,666.54</b>  | <b>5,155,220,500.19</b>  |
| 筹资活动产生的现金流量净额      |        | <b>-1,836,041,066.54</b> | <b>-3,022,155,830.19</b> |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 |        | <b>-31,649,937.24</b>    | <b>30,291,086.57</b>     |
| 五、现金及现金等价物净增加额     |        | <b>-1,165,705,416.34</b> | <b>-5,350,848,401.08</b> |
| 加：期初现金及现金等价物余额     |        | 21,011,546,881.27        | 27,971,971,621.64        |
| 六、期末现金及现金等价物余额     |        | <b>19,845,841,464.93</b> | <b>22,621,123,220.56</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

## 6、母公司现金流量表

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                           | 附注十五 | 本期金额                    | 上期金额                    |
|------------------------------|------|-------------------------|-------------------------|
| 一、经营活动产生的现金流量：               |      |                         |                         |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额 |      | 2,048,525,988.12        |                         |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               |      | 1,615,440,994.14        | 1,628,637,341.23        |
| 拆入资金净增加额                     |      |                         |                         |
| 回购业务资金净增加额                   |      |                         |                         |
| 融出资金净减少额                     |      |                         | 4,987,575,627.01        |
| 代理买卖证券收到的现金净额                |      |                         |                         |
| 收到其他与经营活动有关的现金               |      | 182,432,243.65          | 158,488,747.62          |
| 经营活动现金流入小计                   |      | <b>3,846,399,225.91</b> | <b>6,774,701,715.86</b> |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产支付净额   |      |                         | 648,869,511.37          |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               |      | 237,357,149.27          | 229,363,627.86          |
| 拆入资金净减少额                     |      |                         |                         |
| 回购业务资金净减少额                   |      | 635,687,276.06          | 3,099,394,604.86        |
| 融出资金净增加额                     |      | 464,602,060.05          |                         |
| 代理买卖证券支付的现金净额                |      | 936,441,604.49          | 3,014,541,835.71        |

|                         |  |                          |                          |
|-------------------------|--|--------------------------|--------------------------|
| 支付给职工以及为职工支付的现金         |  | 658,637,037.72           | 676,326,591.62           |
| 支付的各项税费                 |  | 229,485,473.01           | 272,096,448.18           |
| 支付其他与经营活动有关的现金          |  | 169,105,843.09           | 160,082,136.87           |
| 经营活动现金流出小计              |  | <b>3,331,316,443.69</b>  | <b>8,100,674,756.47</b>  |
| 经营活动产生的现金流量净额           |  | <b>515,082,782.22</b>    | <b>-1,325,973,040.61</b> |
| 二、投资活动产生的现金流量：          |  |                          |                          |
| 收回投资所收到的现金              |  |                          |                          |
| 取得投资收益收到的现金             |  | 228,860,000.00           | 330,996,000.00           |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额     |  |                          |                          |
| 收到其他与投资活动有关的现金          |  | 1,834,767.62             | 217,172.59               |
| 投资活动现金流入小计              |  | <b>230,694,767.62</b>    | <b>331,213,172.59</b>    |
| 投资支付的现金                 |  |                          | 866,670,000.00           |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现 |  | 41,078,930.52            | 44,139,119.54            |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额     |  |                          |                          |
| 支付其他与投资活动有关的现金          |  |                          |                          |
| 投资活动现金流出小计              |  | <b>41,078,930.52</b>     | <b>910,809,119.54</b>    |
| 投资活动产生的现金流量净额           |  | <b>189,615,837.10</b>    | <b>-579,595,946.95</b>   |
| 三、筹资活动产生的现金流量：          |  |                          |                          |
| 吸收投资收到的现金               |  |                          |                          |
| 取得借款收到的现金               |  |                          |                          |
| 发行债券收到的现金               |  | 5,236,180,000.00         | 2,075,610,000.00         |
| 收到其他与筹资活动有关的现金          |  |                          |                          |
| 筹资活动现金流入小计              |  | <b>5,236,180,000.00</b>  | <b>2,075,610,000.00</b>  |
| 偿还债务支付的现金               |  | 6,041,290,000.00         | 4,500,930,000.00         |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金       |  | 1,055,667,022.45         | 255,179,618.65           |
| 支付其他与筹资活动有关的现金          |  |                          | 399,110,881.54           |
| 筹资活动现金流出小计              |  | <b>7,096,957,022.45</b>  | <b>5,155,220,500.19</b>  |
| 筹资活动产生的现金流量净额           |  | <b>-1,860,777,022.45</b> | <b>-3,079,610,500.19</b> |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响      |  | <b>-515,935.53</b>       | <b>357,924.19</b>        |
| 五、现金及现金等价物净增加额          |  | <b>-1,156,594,338.66</b> | <b>-4,984,821,563.56</b> |
| 加：期初现金及现金等价物余额          |  | <b>17,030,671,809.06</b> | <b>23,794,872,476.72</b> |
| 六、期末现金及现金等价物余额          |  | <b>15,874,077,470.40</b> | <b>18,810,050,913.16</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

## 7、合并股东权益变动表

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                    | 2017 年 1-6 月     |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    | 少数股东权益         | 股东权益合计            |
|-----------------------|------------------|--------|----|--|------------------|-------|----------------|------------------|------------------|------------------|----|----------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司股东权益       |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                |                   |
|                       | 股本               | 其他权益工具 |    |  | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益         | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            | 其他 |                |                   |
|                       | 优先股              | 永续债    | 其他 |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                |                   |
| 一、上年年末余额              | 1,964,100,000.00 |        |    |  | 9,835,082,591.38 | 0.00  | 710,980,050.56 | 1,178,846,019.19 | 2,376,434,660.46 | 4,676,622,766.89 |    | 143,429,479.59 | 20,885,495,568.07 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                | 0.00              |
| 前期差错更正                |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                |                   |
| 同一控制下企业合并             |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                |                   |
| 其他                    |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                |                   |
| 二、本年初余额               | 1,964,100,000.00 |        |    |  | 9,835,082,591.38 | 0.00  | 710,980,050.56 | 1,178,846,019.19 | 2,376,434,660.46 | 4,676,622,766.89 |    | 143,429,479.59 | 20,885,495,568.07 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“—”号填列） | 982,050,000.00   |        |    |  | -982,050,000.00  | 0.00  | -77,466,917.84 | 0.00             | 0.00             | -75,511,706.71   |    | -5,979,844.12  | -158,958,468.67   |
| （一）综合收益总额             |                  |        |    |  |                  |       | -77,466,917.84 |                  |                  | 513,718,293.29   |    | 4,020,155.88   | 440,271,531.33    |
| （二）股东投入和减少资本          |                  |        |    |  | 0.00             | 0.00  |                |                  |                  |                  |    | 0.00           | 0.00              |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                | 0.00              |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                  |        |    |  |                  |       |                |                  |                  |                  |    |                | 0.00              |

|                  |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                |                   |
|------------------|------------------|------|------|------|------------------|------|----------------|------------------|------------------|------------------|--|----------------|-------------------|
| 3. 股份支付计入股东权益的金额 |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 4. 其他            |                  |      |      |      |                  | 0.00 |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| (三) 利润分配         | 0.00             | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00             | 0.00 | 0.00           | 0.00             | 0.00             | -589,230,000.00  |  | -10,000,000.00 | -599,230,000.00   |
| 1. 提取盈余公积        |                  |      |      |      |                  |      |                |                  | 0.00             | 0.00             |  |                | 0.00              |
| 2. 提取一般风险准备      |                  |      |      |      |                  |      |                | 0.00             |                  | 0.00             |  |                | 0.00              |
| 3. 对股东的分配        |                  |      |      |      |                  |      |                | 0.00             | 0.00             | -589,230,000.00  |  | -10,000,000.00 | -599,230,000.00   |
| 4. 其他            |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| (四) 股东权益内部结转     | 982,050,000.00   |      |      |      | -982,050,000.00  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) | 982,050,000.00   |      |      |      | -982,050,000.00  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 3. 盈余公积弥补亏损      |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 4. 其他            |                  |      |      |      |                  |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| (五) 其他           |                  |      |      |      | 0.00             |      |                |                  |                  |                  |  |                | 0.00              |
| 四、本年年末余额         | 2,946,150,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 8,853,032,591.38 | 0.00 | 633,513,132.72 | 1,178,846,019.19 | 2,376,434,660.46 | 4,601,111,060.18 |  | 137,449,635.47 | 20,726,537,099.40 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

## 合并股东权益变动表（续）

编制单位：国元证券股份有限公司（合并）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                    | 2016 年 1-6 月     |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |
|-----------------------|------------------|--------|----|------|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|----------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司股东权益       |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  | 少数股东权益         | 股东权益合计            |
|                       | 股本               | 其他权益工具 |    |      | 资本公积             | 减：库存股          | 其他综合收益         | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            |                |                   |
|                       | 优先股              | 永续债    | 其他 |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |
| 一、上年年末余额              | 1,964,100,000.00 | 0.00   | 0  | 0.00 | 9,875,592,291.64 | 73,401,721.73  | 555,224,602.30 | 1,052,769,630.12 | 2,105,124,865.64 | 4,454,244,552.95 | 129,715,458.07 | 20,063,369,678.99 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                | 0.00              |
| 前期差错更正                |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                | 0.00              |
| 同一控制下企业合并             |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |
| 其他                    |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                | 0.00              |
| 二、本年年初余额              | 1,964,100,000.00 |        |    |      | 9,875,592,291.64 | 73,401,721.73  | 555,224,602.30 | 1,052,769,630.12 | 2,105,124,865.64 | 4,454,244,552.95 | 129,715,458.07 | 20,063,369,678.99 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“—”号填列） | 0.00             |        |    |      | 0.00             | 397,160,856.60 | 31,766,199.47  | 0.00             | 0.00             | 26,927,454.71    | 6,948,278.02   | -331,518,924.40   |
| （一）综合收益总额             |                  |        |    |      |                  |                | 31,766,199.47  |                  |                  | 510,562,083.71   | 3,183,509.86   | 545,511,793.04    |
| （二）股东投入和减少资本          |                  |        |    |      |                  | 397,160,856.60 |                |                  |                  |                  | 0.00           | -397,160,856.60   |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额      |                  |        |    |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                |                   |

|                  |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              |                   |
|------------------|------------------|------|---|------|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|-----------------|--------------|-------------------|
| 4. 其他            |                  |      |   |      |                  | 397,160,856.60 |                |                  |                  |                  |                 |              | -397,160,856.60   |
| (三) 利润分配         | 0.00             | 0.00 | 0 | 0.00 | 0.00             | 0.00           | 0.00           | 0.00             | 0.00             | 0.00             | -483,634,629.00 | 0.00         | -483,634,629.00   |
| 1. 提取盈余公积        |                  |      |   |      |                  |                |                |                  | 0.00             |                  |                 |              | 0.00              |
| 2. 提取一般风险准备      |                  |      |   |      |                  |                |                | 0.00             |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| 3. 对股东的分配        |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  | -483,634,629.00 |              | -483,634,629.00   |
| 4. 其他            |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| (四) 股东权益内部结转     |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 | 0.00         | 0.00              |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| 3. 盈余公积弥补亏损      |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| 4. 其他            |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 |              | 0.00              |
| (五) 其他           |                  |      |   |      |                  |                |                |                  |                  |                  |                 | 3,764,768.16 | 3,764,768.16      |
| 四、本年年末余额         | 1,964,100,000.00 | 0.00 | 0 | 0.00 | 9,875,592,291.64 | 470,562,578.33 | 586,990,801.77 | 1,052,769,630.12 | 2,105,124,865.64 | 4,481,172,007.66 | 136,663,736.09  |              | 19,731,850,754.59 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭



## 8、股东权益变动表

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                    | 2017 年 1-6 月     |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
|-----------------------|------------------|--------|-----|----|------------------|-------|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                       | 股本               | 其他权益工具 |     |    | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益         | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            | 股东权益合计            |
|                       |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
| 一、上年年末余额              | 1,964,100,000.00 |        |     |    | 9,834,994,832.88 | 0.00  | 517,624,388.74 | 1,178,846,019.19 | 2,306,639,383.74 | 4,119,635,942.69 | 19,921,840,567.24 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 前期差错更正                |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
| 其他                    |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
| 二、本年初余额               | 1,964,100,000.00 |        |     |    | 9,834,994,832.88 | 0.00  | 517,624,388.74 | 1,178,846,019.19 | 2,306,639,383.74 | 4,119,635,942.69 | 19,921,840,567.24 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“—”号填列） | 982,050,000.00   |        |     |    | -982,050,000.00  | 0.00  | -77,071,445.96 | 0.00             | 0.00             | -185,967,042.16  | -263,038,488.12   |
| （一）综合收益总额             |                  |        |     |    |                  |       | -77,071,445.96 |                  |                  | 403,262,957.84   | 326,191,511.88    |
| （二）股东投入和减少资本          |                  |        |     |    |                  | 0.00  |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额      |                  |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  | 0.00              |

|                      |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  |                   |
|----------------------|------------------|--|--|------------------|------|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 4. 其他                |                  |  |  |                  | 0.00 |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| (三) 利润分配             | 0.00             |  |  | 0.00             | 0.00 | 0.00           | 0.00             | 0.00             | -589,230,000.00  | -589,230,000.00   |
| 1. 提取盈余公积            |                  |  |  |                  |      |                |                  | 0.00             | 0.00             | 0.00              |
| 2. 提取一般风险准备          |                  |  |  |                  |      |                | 0.00             | 0.00             | 0.00             | 0.00              |
| 3. 对股东的分配            |                  |  |  |                  |      |                | 0.00             | 0.00             | -589,230,000.00  | -589,230,000.00   |
| 4. 其他                |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| (四) 股东权益内部结转         | 982,050,000.00   |  |  | -982,050,000.00  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 1. 资本公积转增资本<br>(或股本) | 982,050,000.00   |  |  | -982,050,000.00  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 2. 盈余公积转增资本<br>(或股本) |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 3. 盈余公积弥补亏损          |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 4. 其他                |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| (五) 其他               |                  |  |  |                  |      |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 四、本年年末余额             | 2,946,150,000.00 |  |  | 8,852,944,832.88 | 0.00 | 440,552,942.78 | 1,178,846,019.19 | 2,306,639,383.74 | 3,933,668,900.53 | 19,658,802,079.12 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

**股东权益变动表（续）**

编制单位：国元证券股份有限公司（母公司）

2017 年度 1-6 月

单位：元

| 项目                    | 2016 年 1-6 月     |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
|-----------------------|------------------|--------|-----|----|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                       | 股本               | 其他权益工具 |     |    | 资本公积             | 减：库存股          | 其他综合收益         | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            | 股东权益合计            |
|                       |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
| 一、上年年末余额              | 1,964,100,000.00 |        |     |    | 9,875,504,533.14 | 73,401,721.73  | 426,780,672.60 | 1,052,769,630.12 | 2,054,486,605.60 | 4,022,741,219.25 | 19,322,980,938.98 |
| 加：会计政策变更              |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 前期差错更正                |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
| 其他                    |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
| 二、本年年初余额              | 1,964,100,000.00 |        |     |    | 9,875,504,533.14 | 73,401,721.73  | 426,780,672.60 | 1,052,769,630.12 | 2,054,486,605.60 | 4,022,741,219.25 | 19,322,980,938.98 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“－”号填列） | 0.00             |        |     |    | 0.00             | 397,160,856.60 | -19,381,843.56 | 0.00             | 0.00             | -71,881,631.83   | -488,424,331.99   |
| （一）综合收益总额             |                  |        |     |    |                  |                | -19,381,843.56 |                  |                  | 411,752,997.17   | 392,371,153.61    |
| （二）股东投入和减少资本          |                  |        |     |    |                  | 397,160,856.60 |                |                  |                  |                  | -397,160,856.60   |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额      |                  |        |     |    |                  |                |                |                  |                  |                  | 0.00              |

|                  |                  |  |  |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
|------------------|------------------|--|--|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 4. 其他            |                  |  |  |                  | 397,160,856.60 |                |                  |                  |                  | -397,160,856.60   |
| (三) 利润分配         | 0.00             |  |  | 0.00             | 0.00           | 0.00           | 0.00             | 0.00             | -483,634,629.00  | -483,634,629.00   |
| 1. 提取盈余公积        |                  |  |  |                  |                |                |                  | 0.00             | 0.00             | 0.00              |
| 2. 提取一般风险准备      |                  |  |  |                  |                |                | 0.00             |                  | 0.00             | 0.00              |
| 3. 对股东的分配        |                  |  |  |                  |                |                |                  |                  | -483,634,629.00  | -483,634,629.00   |
| 4. 其他            |                  |  |  |                  |                |                |                  |                  |                  | 0.00              |
| (四) 股东权益内部结转     |                  |  |  |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
| 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) 其他           |                  |  |  |                  |                |                |                  |                  |                  |                   |
| 四、本年年末余额         | 1,964,100,000.00 |  |  | 9,875,504,533.14 | 470,562,578.33 | 407,398,829.04 | 1,052,769,630.12 | 2,054,486,605.60 | 3,950,859,587.42 | 18,834,556,606.99 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：蔡咏

主管会计工作负责人：高民和

会计机构负责人：司开铭

# 国元证券股份有限公司

## 财务报表附注

截止 2017 年 6 月 30 日

(除特别说明外, 金额单位为人民币元)

### 一、公司基本情况

#### 1、公司概况

国元证券股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)系于 2007 年 9 月 29 日经中国证监会证监公司字[2007]165 号文核准, 由北京化二股份有限公司定向回购股份、重大资产出售暨以新增股份吸收合并国元证券有限责任公司重组而设立, 吸收合并后存续公司注册资本变更为 146,410 万元。2007 年 10 月 25 日, 北京化二股份有限公司完成了迁址、变更经营范围以及资产、业务、人员等置入、置出工作后, 正式更名为国元证券股份有限公司, 统一社会信用代码: 91340000731686376P。2007 年 10 月 30 日, 公司股票在深圳证券交易所复牌, 股票代码 000728, 股票简称“国元证券”。2009 年 10 月根据国元证券股份有限公司 2008 年度股东大会决议和修改后公司章程的规定, 并经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1099 号文核准, 公司公开增发 5 亿股人民币普通股, 增发后公司的注册资本变更为人民币 196,410 万元。2017 年 5 月份根据国元证券股份有限公司 2016 年度股东大会权益分派决议, 以资本公积向全体股东每 10 股转增 5 股, 转增后公司股本变更为 294,615 万元。

国元证券有限责任公司是国元证券股份有限公司的前身, 由原安徽省国际信托投资公司和原安徽省信托投资公司作为主发起人, 以各自拥有的证券营业部及证券经营性资产为基础, 联合其他 12 家法人单位共同发起设立的综合类证券公司。国元证券有限责任公司于 2001 年 9 月 27 日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监机构字[2001]194 号文件批准开业, 2001 年 10 月 15 日经安徽省工商行政管理局登记注册, 注册资本 203,000 万元。国元证券有限责任公司被北京化二股份有限公司吸收合并后, 已办理注销。

本公司经营范围: 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; 为期货公司提供中间介绍业务; 代销金融产品; 保险兼业代理业务。主要业务为证券的代理买

卖；证券自营买卖；证券承销；证券投资咨询；客户资产管理等。

公司注册地：安徽省合肥市梅山路 18 号，总部办公地：安徽省合肥市梅山路 18 号。

法定代表人：蔡咏。

财务报告批准报出日：本财务报表业经公司董事会于 2017 年 8 月 21 日决议批准报出。

## 2、合并财务报表范围

### (1) 本报告期末纳入合并范围的子公司

| 序号 | 子公司全称             | 子公司简称 | 持股比例（%） |    |
|----|-------------------|-------|---------|----|
|    |                   |       | 直接      | 间接 |
| 1  | 国元证券（香港）有限公司      | 国元香港  | 100.00  | —  |
| 2  | 国元股权投资有限公司        | 国元直投  | 100.00  | —  |
| 3  | 国元期货有限公司          | 国元期货  | 98.41   | —  |
| 4  | 国元创新投资有限公司        | 国元创新  | 100.00  | —  |
| 5  | 安徽省股权托管交易中心有限责任公司 | 股交中心  | 50.00   | —  |

上述子公司具体情况详见本附注七、在其他主体中的权益。

### (2) 本报告期纳入合并范围的结构化主体

| 序号 | 结构化主体全称              | 结构化主体简称 | 自有资金期末<br>份额比例(%) |
|----|----------------------|---------|-------------------|
| 1  | 国元黄山 1 号限定型集合资产管理计划  | 黄山 1 号  | 15.56%            |
| 2  | 国元利贞限额特定集合资产管理计划     | 国元利贞    | 100.00%           |
| 3  | 国元浦江 1 号债券分级集合资产管理计划 | 浦江 1 号  | 15.00%            |
| 4  | 国元创新驱动集合资产管理计划       | 创新驱动    | 16.05%            |
| 5  | 国元元赢 1 号债券分级集合资产管理计划 | 元赢 1 号  | 15.09%            |
| 6  | 国元元赢 3 号债券分级集合资产管理计划 | 元赢 3 号  | 15.01%            |
| 7  | 国元元赢 4 号债券分级集合资产管理计划 | 元赢 4 号  | 15.32%            |
| 8  | 国元元赢 6 号债券分级集合资产管理计划 | 元赢 6 号  | 15.02%            |
| 9  | 国元元赢 11 号集合资产管理计划    | 元赢 11 号 | 15.04%            |
| 10 | 国元元赢 16 号集合资产管理计划    | 元赢 16 号 | 15.10%            |
| 11 | 国元证券招元 7 号定向资产管理计划   | 招元 7 号  | 100.00%           |

|    |                     |         |         |
|----|---------------------|---------|---------|
| 12 | 国元证券元中 26 号定向资产管理计划 | 元中 26 号 | 100.00% |
| 13 | 国元证券元中 27 号定向资产管理计划 | 元中 27 号 | 100.00% |
| 14 | 国元证券元惠 37 号定向资产管理计划 | 元惠 37 号 | 100.00% |
| 15 | 国元证券元惠 38 号定向资产管理计划 | 元惠 38 号 | 100.00% |
| 16 | 国元证券元惠 39 号定向资产管理计划 | 元惠 39 号 | 100.00% |
| 17 | 国元元赢 19 号集合资产管理计划   | 元赢 19 号 | —       |
| 18 | 国元元赢 13 号集合资产管理计划   | 元赢 13 号 | —       |

注：元赢 13 号、元赢 19 号已于本报告期内清算。

上述结构化主体具体情况详见本附注七、在其他主体中的权益。

(3) 本报告期内合并财务报表范围变化：

本报告期内减少结构化主体

| 序号 | 结构化主体全称            | 结构化主体简称 | 注销时间        | 未纳入合并范围原因 |
|----|--------------------|---------|-------------|-----------|
| 1  | 国元证券招元 3 号定向资产管理计划 | 招元 3 号  | 2016 年 12 月 | 清算        |
| 2  | 国元证券招元 5 号定向资产管理计划 | 招元 5 号  | 2016 年 12 月 | 清算        |
| 3  | 国元元鑫 1 号集合资产管理计划   | 元鑫 1 号  | 2016 年 7 月  | 清算        |

## 二、财务报表的编制基础

### 1、编制基础

公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)，以及中国证券监督管理委员会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》(2014 年修订)、《证券公司年度报告内容与格式准则》(2013 年修订)和《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式(2016 年修订)》的披露规定编制财务报表。

### 2、持续经营

本公司对自报告期末起 12 个月的持续经营能力进行了评估，未发现影响本公司持续经营能力的事项，本公司以持续经营为基础编制财务报表是合理的。

## 三、重要会计政策及会计估计

本公司下列重要会计政策、会计估计根据企业会计准则制定。未提及的业务按企业会计准则中相关会计政策执行。

### 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

本公司正常营业周期为一年。

### 4、记账本位币

采用人民币为记账本位币，境外子公司按所在国家或地区的货币为记账本位币。

### 5、同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

#### (1) 同一控制下的企业合并

本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的账面价值计量。被合并各方采用的会计政策与本公司不一致的，本公司在合并日按照本公司会计政策进行调整，在此基础上按照调整后的账面价值确认。

在合并中取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

本公司为进行企业合并而发生的各项直接相关费用，包括为进行企业合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费等，于发生时计入当期损益。

企业合并中发行权益性证券发生的手续费、佣金等，抵减权益性证券溢价收入，溢价收入不足冲减的，冲减留存收益。

#### (2) 非同一控制下的企业合并

本公司在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量。公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。

本公司在购买日对合并成本进行分配，确认所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。

本公司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；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的差额，经复核后，计入当期损益。

企业合并中取得的被购买方除无形资产外的其他各项资产（不仅限于被购买方原已确认的资产），其所带来的经济利益很可能流入本公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按公允价值计量；公允价值能够可靠计量的无形资产，单独确认为无形资产并按公允价值计量；取得的被购买方除或有负债以外的其他各项负债，履行有关义务很可能导致经济利益流出本公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按照公允价值计量；取得的被购买方或有负债，其公允价值能可靠计量的，单独确认为负债并按照公允价值计量。

本公司在企业合并中取得的被购买方的可抵扣暂时性差异，在购买日不符合递延所得税资产确认条件的，不予以确认。购买日后12个月内，如取得新的或进一步的信息表明购买日的相关情况已经存在，预期被购买方在购买日可抵扣暂时性差异带来的经济利益能够实现的，确认相关的递延所得税资产，同时减少商誉，商誉不足冲减的，差额部分确认为当期损益；除上述情况以外，确认与企业合并相关的递延所得税资产，计入当期损益。

非同一控制下企业合并，购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，应当于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，应当计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

## 6、合并财务报表的编制方法

### （1）合并范围的确定

本公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，不仅包括根据表决权（或类似表决权）本身或者结合其他安排确定的子公司，也包括基于一项或多项合同安排决定的结构化主体。

### （2）合并财务报表的编制方法

所有纳入合并财务报表合并范围的主体所采用的会计政策、会计期间与本公司一致，如采用的会计政策、会计期间与本公司不一致的，在编制合并财务报表时，按本公司的会计政策、会计期间进行必要的调整。

对于非同一控制下企业合并取得的子公司，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对

其财务报表进行调整。合并财务报表以本公司及子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，按照权益法调整对子公司的长期股权投资后，由本公司编制。

合并财务报表时抵销本公司与各子公司、各子公司相互之间发生的内部交易对合并资产负债表、合并利润表、合并现金流量表、合并所有者权益变动表的影响。

子公司少数股东应占的权益和损益分别在合并资产负债表中所有者权益项目下和合并利润表中净利润项目下单独列示。子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额而形成的余额，冲减少数股东权益。

在报告期内，若因同一控制下企业合并增加子公司的，则调整合并资产负债表的期初数；将子公司合并当期期初至报告期期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；将子公司合并当期期初至报告期期末的现金流量纳入合并现金流量表，同时对比较报表的相关项目进行调整，视同合并后的报告主体在以前期间一直存在。

在报告期内，若因非同一控制下企业合并增加子公司的，则不调整合并资产负债表期初数；将子公司自购买日至报告期期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司自购买日至报告期期末的现金流量纳入合并现金流量表。通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，本公司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其他综合收益的，与其相关的其他综合收益转为购买日所属当期投资收益。

在报告期内，本公司处置子公司，则该子公司期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司期初至处置日的现金流量纳入合并现金流量表。因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权时，对于处置后的剩余股权投资，本公司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。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益，在丧失控制权时转为当期投资收益。

本公司因购买少数股权新取得的长期股权投资与按照新增持股比例计算应享有子公司的可辨认净资产份额之间的差额，以及在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司净资产份额的差额，均调整合并资产负债表中的资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整

留存收益。

## 7、现金及现金等价物的确定标准

在编制现金流量表时，将本公司库存现金以及可以随时用于支付的存款确认为现金。将同时具备期限短（从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知现金、价值变动风险很小四个条件的投资，确定为现金等价物。

## 8、外币业务和外币报表折算

### （1）外币业务

外币业务采用交易发生日的即期汇率作为折算汇率将外币金额折合成人民币记账。

外币货币性项目余额按资产负债表日即期汇率折算，由此产生的汇兑差额，除属于与购建符合资本化条件的资产相关的外币专门借款产生的汇兑差额按照借款费用资本化的原则处理外，均计入当期损益。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折算，不改变其记账本位币金额。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，由此产生的汇兑差额计入当期损益或资本公积。

### （2）外币财务报表的折算

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，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率或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，在资产负债表所有者权益项目下单独列示。

处置境外经营时，将资产负债表中所有者权益项目下列示的、与该境外经营相关的外币财务报表折算差额，自所有者权益项目转入处置当期损益；部分处置境外经营的，按处置的比例计算处置部分的外币财务报表折算差额，转入处置当期损益。

## 9、金融工具

### （1）金融资产

本公司将持有的金融资产分为四类：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。

所有金融资产在初始确认时都以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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，相关交

易费用计入初始确认金额。支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或已到付息期但尚未领取的债券利息，单独确认为应收项目。

在初始确认时将某金融资产或某金融负债划分为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后，不能重分类为其他类金融资产或金融负债；其他类金融资产或金融负债也不能重分类为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。

卖出同一品种金融资产时，按移动加权平均法计算结转资产成本。

金融资产满足下列条件之一时，终止确认：

A、收取该金融资产现金流量的合同权利已终止；

B、该金融资产已转移，且符合新《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》规定的金融资产终止确认条件。

金融资产持有期间取得的利息或现金股利，确认为投资收益。

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的后续计量采用公允价值计量，所有已实现和未实现的损益均记入当期损益。

本公司将不作为有效套期工具的衍生工具，划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。衍生工具包括远期合同、期货合同、互换和期权，以及具有远期合同、期货合同、互换和期权中一种或一种以上特征的工具。

该类金融资产发生的公允价值变动计入公允价值变动损益。处置该类金融资产，其公允价值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损益。

②持有至到期投资

持有至到期投资指到期日固定、回收金额固定或可确定，且企业有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

该类投资的账面价值以实际利率法计算的摊余成本减去减值准备计量，在持有期间按照摊余成本和实际利率计算确认的利息收入、减值准备、处置收益，均计入投资收益。

因持有意图或能力发生改变，使某项投资不再适合划分为持有至到期投资的，将其重分类为可供出售金融资产，并以公允价值进行后续计量。重分类日，该投资的账面价值与

公允价值之间的差额计入所有者权益，在该可供出售金融资产发生减值或终止确认时转出，计入当期损益。

### ③贷款和应收款项

本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作为贷款和应收款项，本公司持有的该类资产主要是日常经营过程中形成的应收款项等债权。

### ④可供出售金融资产

可供出售金融资产是初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，以及没有划分为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、贷款和应收款项的金融资产。

该类资产持有期间取得的利息或现金股利，计入投资收益。

该类资产公允价值变动计入资本公积（其他资本公积），在终止确认或发生减值时，以前在资本公积中列示的累计公允价值变动转出，记入当期投资收益。

### ⑤金融资产减值

A、对于持有至到期投资、贷款，有客观证据表明其发生了减值的，根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间的差额计算确认减值损失。

B、资产负债表日，如果单项金额重大的某项可供出售金融资产的公允价值持续一年低于取得成本或已经低于取得成本的 50%，可认定该可供出售金融资产已发生减值，应将原直接计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。

可供出售金融资产发生减值的，将原计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。可供出售金融资产的转回应区分为可供出售权益工具投资转回和可供出售债务工具转回两种情况。可供出售权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回；在活跃市场中没有报价且公允价值不能可靠计量的权益工具投资或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发生的减值损失，不得转回。对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的，原确认的减值损益应当予以转回，计入当期损益。

融出证券和已上市的直接投资形成的股权计提减值比照上述办法执行。

C、应收款项资产减值准备的确认标准与计提方法详见“三、11 应收款项坏账准备的确认标准、计提方法”。

## （2）金融负债

本公司的金融负债划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

所有金融负债在初始确认时都以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

金融负债的现时义务全部或部分已解除时，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，企业应当将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

### ①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、衍生金融负债和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。该类公允价值的变动记入当期损益。交易性金融负债主要是指为了近期内回购而持有的创设权证等金融工具。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负债，主要是指本公司基于风险管理、投资策略等需要所作的指定。

### ②其他金融负债

指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债，比如本公司发行的债券、因购买商品产生的应付账款、长期应付款等，一般采用摊余成本进行后续计量。

## （3）公允价值确定方法

公允价值是指在公平交易中，熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。在公平交易中，交易双方应当是持续经营企业，不打算或不需要进行清算、重大缩减经营规模，或在不利条件下仍进行交易。

### ①金融工具公允价值的初始确认

初始取得或源生的金融资产或承担的金融负债，以市场交易价格作为确定其公允价值的基础。债务工具的公允价值，根据取得日或发行日的市场情况和当前市场情况，或其他类似债务工具（即有类似的剩余期限、现金流量模式、标价币种、信用风险、担保和利率基础等）的当前市场利率确定。债务人的信用风险和适用的信用风险贴水在债务工具发行后没有改变的，使用基准利率估计当前市场利率确定债务工具的公允价值。债务人的信用

风险和相应的信用风险贴水在债务工具发行后发生改变的，参考类似债务工具的当前价格或利率，并考虑金融工具之间的差异调整，确定债务工具的公允价值。

采用未来现金流量折现法确定金融工具公允价值的，使用合同条款和特征在实质上相同的其他金融工具的市场收益率作为折现率。金融工具的条款和特征，包括金融工具本身的信用质量、合同规定采用固定利率计息的剩余期间、支付本金的剩余期间以及支付时采用的货币等。没有标明利率的短期应收款项和应付款项的现值与实际交易价格相差很小的，可以按照实际交易价格计量。

## ②金融工具公允价值后续确认

对存在活跃市场的金融工具，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

对不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并通过定期校验，确保估值技术的有效性。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，公司应根据具体情况与监管部门或中介机构进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

## (4) 金融资产转移确认依据和计量及会计处理方法

①本公司在已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方时终止对该项金融资产的确认。

本公司在金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项的差额计入当期损益：

A、所转移金融资产的账面价值；

B、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。

本公司的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：

A、终止确认部分的账面价值；

B、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。

②金融资产转移不满足终止确认条件的，继续确认该金融资产，将所收到的对价确认为一项金融负债。

对于采用继续涉入方式的金融资产转移，本公司应当按照继续涉入所转移金融资产的程度确认一项金融资产，同时确认一项金融负债。

#### (5) 金融资产（不含应收款项）减值的测试方法及会计处理方法

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产外，本公司于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

①对于持有至到期投资、贷款，有客观证据表明其发生了减值的，根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间的差额计算确认减值损失。

②资产负债表日，如果单项金额重大的某项可供出售金融资产的公允价值持续一年低于取得成本或已经低于取得成本的50%，可认定该可供出售金融资产已发生减值，应将原直接计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。已上市的直接投资形成的股权减值计提，比照以上办法执行。

可供出售金融资产发生减值的，将原计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。可供出售金融资产的转回应区分为可供出售权益工具投资转回和可供出售债务工具转回两种情况。可供出售权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回；在活跃市场中没有报价且公允价值不能可靠计量的权益工具投资或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发生的减值损失，不得转回。对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的，原确认的减值损益应当予以转回，计入当期损益。

公司根据融资融券业务的风险特征，对融资融券业务按照资产负债表日融资融券余额的0.5%计提坏账准备。

## 10、衍生金融工具

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行确认，并以其公允价值进



行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生金融工具公允价值变动直接计入当期损益。

## 11、坏账准备的确认标准、计提方法

(1) 应收款项（应收账款和其他应收款）坏账准备

### ① 单项金额重大的应收款项坏账准备计提

单项金额重大的判断依据或金额标准：本公司将 1000 万元以上应收款项确定为单项金额重大。

单项金额重大应收款项坏账准备的计提方法：对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，并据此计提相应的坏账准备。对于单项金额重大的应收款项单独测试未发生减值的，不计提坏账准备。

### ② 按组合计提坏账准备应收款项

确定组合的依据：对单项金额不重大的应收款项，本公司以账龄作为信用风险特征组合。

按组合计提坏账准备的计提方法：账龄分析法

组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的：

| 账 龄          | 应收款项计提比例(%) | 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        | 20          | 20           |
| 3—4 年        | 50          | 50           |
| 4—5 年        | 80          | 80           |
| 5 年以上        | 100         | 100          |

### ③ 单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收款项

对单项金额不重大但个别信用风险特征明显不同，已有客观证据表明按账龄分析法计提的坏账准备不能反映实际情况，本公司单独进行减值测试，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，并据此计提相应的坏账准备。

## (2) 融资融券业务形成的应收融资融券款

未能按期收回的融资融券款转入应收融资融券款逾期 30 天，且客户维持担保比例低于 100%，按应收融资融券款与客户账面资产价值（计算维持担保比例方法）的差额全额计提。

## (3) 公司类贷款业务形成的应收账款

公司类贷款业务形成的应收账款按照资产负债表日业务余额的 1%计提坏账准备。未能按期收回的款项转入应收账款逾期 30 天，且客户维持担保比例低于 100%，按应收账款与抵押品资产价值（计算维持担保比例方法）的差额全额计提。

## 12、长期股权投资

本公司长期股权投资包括对被投资单位实施控制、重大影响的权益性投资，以及对合营企业的权益性投资。本公司能够对被投资单位施加重大影响的，为本公司的联营企业。

### (1) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

共同控制，是指按照合同约定对某项经济活动所共有的控制，仅在与该项经济活动相关的重要财务和经营决策需要分享控制权的投资方一致同意时存在。投资企业与其他方对被投资单位实施共同控制的，被投资单位为其合营企业。

重大影响，是指对一个企业的财务和经营决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。投资企业能够对被投资单位施加重大影响的，被投资单位为本公司联营企业。

### (2) 投资成本的确定

#### ① 企业合并形成的长期股权投资

A、同一控制下的企业合并，公司以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式以及以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长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付合并对价之间的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。合并发生的各项直接相关费用，包括为进行合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益。

B、非同一控制下的企业合并，公司按照购买日确定的合并成本作为长期股权投资的初始投资成本。合并成本为购买日购买方为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值。购买方为企业合并而发生的审计、法律服

务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。通过多次交易分步实现的非同一控制下企业合并，以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为该项投资的初始投资成本。本公司将合并协议约定的或有对价作为企业合并转移对价的一部分，按照其在购买日的公允价值计入企业合并成本。

## ② 其他方式取得的长期股权投资

A、以支付现金方式取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为初始投资成本。初始投资成本包括与取得长期股权投资直接相关的费用、税金及其他必要支出。

B、以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

C、在非货币性资产交换具备商业实质和换入资产或换出资产的公允价值能够可靠计量的前提下，非货币性资产交换换入的长期股权投资以换出资产的公允价值为基础确定其初始投资成本，除非有确凿证据表明换入资产的公允价值更加可靠；不满足上述前提的非货币性资产交换，以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为换入长期股权投资的初始投资成本。

D、通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本按照公允价值为基础确定。

## (3) 后续计量及损益确认方法

### ① 成本法核算的长期股权投资

公司对子公司的长期股权投资，采用成本法核算。除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外，公司按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认当期投资收益。

### ② 权益法核算的长期股权投资

对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的差额，不调整长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。

公司按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确

认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应享有的部分，相应减少长期股权投资的账面价值；对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入所有者权益。

在确认应享有被投资单位净损益的份额时，以取得投资时被投资单位可辨认净资产的公允价值为基础，并按照公司的会计政策及会计期间，对被投资单位的净利润进行调整后确认。在持有投资期间，被投资单位编制合并财务报表的，以合并财务报表中的净利润、其他综合收益和其他所有者权益变动中归属于被投资单位的金额为基础进行核算。

公司与联营企业、合营企业之间发生的未实现内部交易损益按照应享有的比例计算归属于公司的部分，予以抵销，在此基础上确认投资收益。与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于资产减值损失的，全额确认。

在公司确认应分担被投资单位发生的亏损时，按照以下顺序进行处理：首先，冲减长期股权投资的账面价值。其次，长期股权投资的账面价值不足以冲减的，以其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益账面价值为限继续确认投资损失，冲减长期应收项目等的账面价值。最后，经过上述处理，按照投资合同或协议约定企业仍承担额外义务的，按预计承担的义务确认预计负债，计入当期投资损失。被投资单位以后期间实现盈利的，公司在扣除未确认的亏损分担额后，按与上述相反的顺序处理，减记已确认预计负债的账面余额、恢复其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益及长期股权投资的账面价值，同时确认投资收益。

### ③长期股权投资的处置

处置长期股权投资，其账面价值与实际取得价款的差额，计入当期损益。

采用权益法核算的长期股权投资，在处置该项投资时，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础，按相应比例对原计入其他综合收益的部分进行会计处理。因被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，按比例结转入当期损益，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。

因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资单位的共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则核算，其在丧失共同控制或重大影响之日的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合

收益，在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。因被投资方除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，在终止采用权益法核算时全部转入当期损益。

因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资单位控制权的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或重大影响的，改按权益法核算，并对该剩余股权视同自取得时即采用权益法核算进行调整；处置后的剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按金融工具确认和计量准则的有关规定进行会计处理，其在丧失控制之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

处置的股权是因追加投资等原因通过企业合并取得的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权采用成本法或权益法核算的，购买日之前持有的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益和其他所有者权益按比例结转；处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则进行会计处理的，其他综合收益和其他所有者权益全部结转。

### 13、固定资产

#### (1) 固定资产确认条件

固定资产指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有，单价在 5,000 元（不含 5,000 元）以上，并且使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

固定资产在同时满足下列条件时，按取得时的实际成本予以确认：

- ①与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业；
- ②该固定资产的成本能够可靠地计量。

#### (2) 各类固定资产的折旧方法

公司为经营管理或出租等而持有的，单价在 5,000 元（不含 5,000 元）以上、使用年限在 1 年（不含 1 年）以上的有形资产，计入固定资产。包括房屋及建筑物、机器设备、交通运输设备等。购买计算机硬件所附带的软件，未单独计价的，应并入计算机硬件作为固定资产管理；单独计价的软件，计入无形资产。

当一项固定资产的某组成部分在使用效能上与该项资产相对独立，且具有不同使用年限，适用不同折旧率，并以不同方式为公司带来经济利益，该组成部分符合固定资产条件时，应将该组成部分单独确认为固定资产。

经营用固定资产与非经营用固定资产应当分类管理。

不符合固定资产条件，单位价值在 1,000 元（含 1,000 元）以上的物品，作为低值易耗品。低值易耗品可一次性摊入费用。单位价值在 1,000 元（不含 1,000 元）以下的物品，作为费用列支。固定资产应当按月计提折旧，固定资产的折旧率，按固定资产原值、预计残值率和分类折旧年限计算确定；公司的固定资产采用平均年限法计提折旧，分类折旧年限见附表。固定资产的残值率按原值的 3% 确定。

固定资产折旧采用年限平均法分类计提，根据固定资产类别、预计使用寿命和预计净残值率确定折旧率。如固定资产各组成部分的使用寿命不同或者以不同方式为企业供经济利益，则选择不同折旧率或折旧方法，分别计提折旧。

各类固定资产折旧年限和年折旧率如下：

| 类 别     | 折旧年限（年） | 净残值率（%） | 年折旧率（%）   |
|---------|---------|---------|-----------|
| 房屋及建筑物  | 25-45   | 3       | 2.16-3.88 |
| 机械及动力设备 | 10      | 3       | 9.70      |
| 电子及办公设备 | 5       | 3       | 19.40     |
| 运输设备    | 8       | 3       | 12.13     |

#### 14、在建工程

##### （1）在建工程的类别

在建工程以立项项目分类核算。

##### （2）在建工程结转为固定资产的标准和时点

在建工程项目按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的全部支出，作为固定资产的入账价值。包括建筑费用、机器设备原价、其他为使在建工程达到预定可使用状态所发生的必要支出以及在资产达到预定可使用状态之前为该项目专门借款所发生的借款费用及占用的一般借款发生的借款费用。本公司在工程安装或建设完成达到预定可使用状态时将在建工程转入固定资产。所建造的已达到预定可使用状态、但尚未办理竣工决算的固定资产，自达到预定可使用状态之日起，根据工程预算、造价或者工程实际成本等，按估计的价值转入固定资产，并按本公司固定资产折旧政策计提固定资产的折旧，待办理竣工决算后，再按实际成本调整原来的暂估价值，但不调整原已计提的折旧额。

#### 15、无形资产

##### （1）无形资产的计价方法

①公司取得无形资产时按成本进行初始计量

外购无形资产的成本，包括购买价款、相关税费以及直接归属于使该项资产达到预定用途所发生的其他支出。

②后续计量

在取得无形资产时分析判断其使用寿命。

对于使用寿命有限的无形资产，在为企业带来经济利益的期限内按直线法摊销；无法预见无形资产为企业带来经济利益期限的，视为使用寿命不确定的无形资产，不予摊销。

(2) 无形资产使用寿命及摊销

① 使用寿命有限的无形资产的使用寿命估计情况：

| 项 目   | 预计使用寿命 | 依 据                   |
|-------|--------|-----------------------|
| 交易席位费 | 10 年   | 行业惯例                  |
| 软件    | 3 年    | 参考能为公司带来经济利益的期限确定使用寿命 |

每年年度终了，公司对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。经复核，本期末无形资产的使用寿命及摊销方法与以前估计未有不同。

② 使用寿命不确定的无形资产的判断依据

截至资产负债表日,本公司没有使用寿命不确定的无形资产。

**16、长期待摊费用**

长期待摊费用为已经发生但应由本期和以后各期负担的分摊期限在一年以上的各项费用。

长期待摊费用在受益期内平均摊销。

公司对以经营租赁方式租入的固定资产进行的改良，其发生的符合资本化条件的各项支出，记入“长期待摊费用”，并在5年内进行摊销。如果5年内同一经营租入固定资产又发生类似改良支出，将上次未摊完的长期待摊费用余额一次性计入当期损益。

**17、商誉**

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是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。

商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。

## 18、长期资产减值

(1) 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、无形资产等长期资产，于资产负债表日存在减值迹象的，进行减值测试。减值测试结果表明资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额计提减值准备并计入减值损失。可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。资产减值准备按单项资产为基础计算并确认，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组确定资产组的可收回金额。资产组是能够独立产生现金流入的最小资产组合。

### (2) 商誉减值测试

商誉至少在每年年度终了进行减值测试。

本公司进行商誉减值测试，对于因企业合并形成的商誉的账面价值，自购买日起按照合理的方法分摊至相关的资产组；难以分摊至相关的资产组的，将其分摊至相关的资产组组合。在将商誉的账面价值分摊至相关的资产组或者资产组组合时，按照各资产组或者资产组组合的公允价值占相关资产组或者资产组组合公允价值总额的比例进行分摊。公允价值难以可靠计量的，按照各资产组或者资产组组合的账面价值占相关资产组或者资产组组合账面价值总额的比例进行分摊。

在对包含商誉的相关资产组或者资产组组合进行减值测试时，如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，先对不包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，计算可收回金额，并与相关账面价值相比较，确认相应的减值损失。再对包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，比较这些相关资产组或者资产组组合的账面价值（包括所分摊的商誉的账面价值部分）与其可收回金额，如相关资产组或者资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认商誉的减值损失。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

## 19、买入返售和卖出回购款项

买入返售交易按照合同或协议的约定，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”列示。



卖出回购交易按照合同或协议，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”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。

公司根据业务类别风险特征，对股票质押式回购业务和约定购回式证券交易业务按照资产负债表日业务余额的1%计提坏账准备。

## 20、职工薪酬

职工薪酬，是指本公司为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。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。本公司提供给职工配偶、子女、受赡养人、已故员工遗属及其他受益人等的福利，也属于职工薪酬。

### （1）短期薪酬的会计处理方法

#### ①职工基本薪酬（工资、奖金、津贴、补贴）

本公司在职工为其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，其他会计准则要求或允许计入资产成本的除外。

#### ②职工福利费

本公司发生的职工福利费，在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的，按照公允价值计量。

③医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金，以及工会经费和职工教育经费

本公司为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金，以及按规定提取的工会经费和职工教育经费，在职工为其提供服务的会计期间，根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额，并确认相应负债，计入当期损益或相关资产成本。

#### ④短期带薪缺勤

本公司在职工提供服务从而增加了其未来享有的带薪缺勤权利时，确认与累积带薪缺勤相关的职工薪酬，并以累积未行使权利而增加的预期支付金额计量。本公司在职工实际发生缺勤的会计期间确认与非累积带薪缺勤相关的职工薪酬。

#### ⑤短期利润分享计划

利润分享计划同时满足下列条件的，本公司确认相关的应付职工薪酬：

- A、本公司因过去事项导致现在具有支付职工薪酬的法定义务或推定义务；
- B、因利润分享计划所产生的应付职工薪酬义务金额能够可靠估计。

### (2) 离职后福利的会计处理方法

#### ①设定提存计划

本公司在职工为其提供服务的会计期间，将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。

根据设定提存计划，预期不会在职工提供相关服务的年度报告期结束后十二个月内支付全部应缴存金额的，本公司参照相应的折现率（根据资产负债表日与设定提存计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定），将全部应缴存金额以折现后的金额计量应付职工薪酬。

#### ②设定受益计划

##### A、确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本

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做出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的归属期间。本公司按照相应的折现率（根据资产负债表日与设定受益计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定）将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。

##### B、确认设定受益计划净负债或净资产

设定受益计划存在资产的，本公司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，本公司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。

### C、确定应计入资产成本或当期损益的金额

服务成本，包括当期服务成本、过去服务成本和结算利得或损失。其中，除了其他会计准则要求或允许计入资产成本的当期服务成本之外，其他服务成本均计入当期损益。

设定受益计划净负债或净资产的利息净额，包括计划资产的利息收益、设定受益计划义务的利息费用以及资产上限影响的利息，均计入当期损益。

### D、确定应计入其他综合收益的金额

重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动，包括：

(a) 精算利得或损失，即由于精算假设和经验调整导致之前所计量的设定受益计划义务现值的增加或减少；

(b) 计划资产回报，扣除包括在设定受益计划净负债或净资产的利息净额中的金额；

(c) 资产上限影响的变动，扣除包括在设定受益计划净负债或净资产的利息净额中的金额。

上述重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动直接计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但本公司可以在权益范围内转移这些在其他综合收益中确认的金额。

#### (3) 辞退福利的会计处理方法

本公司向职工提供辞退福利的，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企业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企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

辞退福利预期在年度报告期结束后十二个月内不能完全支付的，参照相应的折现率（根据资产负债表日与设定受益计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定）将辞退福利金额予以折现，以折现后的金额计量应付职工薪酬。

#### (4) 其他长期职工福利的会计处理方法

①符合设定提存计划条件的

本公司向职工提供的其他长期职工福利，符合设定提存计划条件的，将全部应缴存金额以折现后的金额计量应付职工薪酬。

②符合设定受益计划条件的

在报告期末，本公司将其他长期职工福利产生的职工薪酬成本确认为下列组成部分：

A、服务成本；

B、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额；

C、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。

为简化相关会计处理，上述项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

## 21、预计负债

本公司涉及诉讼、债务担保、亏损合同、重组事项时，如该等事项很可能需要未来以交付资产或提供劳务、其金额能够可靠计量的，确认为预计负债。

### (1) 预计负债的确认标准

与或有事项相关的义务同时满足下列条件时，本公司确认为预计负债：

①该义务是本公司承担的现时义务；

②该义务的履行很可能导致经济利益流出本公司；

③该义务的金额能够可靠地计量。

### (2) 预计负债的计量方法

本公司预计负债按履行相关现时义务所需的支出的最佳估计数进行初始计量。本公司在确定最佳估计数时，综合考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。对于货币时间价值影响重大的，通过对相关未来现金流出进行折现后确定最佳估计数。

最佳估计数分别以下情况处理：

①所需支出存在一个连续范围（或区间），且该范围内各种结果发生的可能性相同的，则最佳估计数按照该范围的中间值即上下限金额的平均数确定。

②所需支出不存在一个连续范围（或区间），或虽然存在一个连续范围但该范围内各种结果发生的可能性不相同的，如或有事项涉及单个项目的，则最佳估计数按照最可能发生金额确定；如或有事项涉及多个项目的，则最佳估计数按各种可能结果及相关概率计算确定。

本公司清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额在基本确定

能够收到时，作为资产单独确认，确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

## 22、利润分配

### (1) 盈余公积计提

公司按照净利润（减弥补亏损）的10%计提法定盈余公积；按照公司章程或者股东大会决议提取任意盈余公积。

### (2) 风险准备计提

母公司国元证券根据《金融企业财务规则》和证监机构字[2007]320号《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》的规定，按照当期净利润的10%提取一般风险准备；根据《证券法》和证监机构字[2007]320号的规定，按照当期净利润的10%提取交易风险准备金。提取的一般风险准备和交易风险准备金分别计入“一般风险准备”和“交易风险准备”项目核算。

子公司国元期货有限公司根据《金融企业财务规则》及《金融企业财务规则—实施指南》规定，按照当期净利润（减弥补亏损）的10%提取一般风险准备。提取的一般风险准备计入“一般风险准备”项目核算。

## 23、收入

在各项业务合同签订以后，在规定的计算期内按应收收入的数额确认营业收入的实现，或者在劳务已经提供，同时收讫价款或取得收取价款权利的凭证时，确认营业收入的实现。其中：

### (1) 手续费及佣金净收入

#### ① 证券经纪业务净收入

代理买卖证券手续费收入，于代理买卖证券交易日确认收入。代理兑付债券手续费收入，于代理兑付证券业务完成且实际收讫价款或取得收款证据时予以确认。代理保管证券手续费收入，于代理保管服务完成且实际收讫价款或取得收款证据时予以确认。

#### ② 期货经纪业务净收入

根据期货代理合同书确定的收费标准，在代理交易发生时，确定每笔交易的手续费，交易业务发生后直接在客户保证金账户中结算扣除。

#### ③ 投资银行业务净收入

证券承销收入，以全额承购包销方式出售代发行的证券在将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价及相关发行费用后确认为证券承销收入；以余额承购包销或代销方式进行承销业务的证券于发行结束后，与发行人结算发行价款时，按约定收取的手续费抵减相关发行费用后确认。证券保荐业务收入和财务顾问收入，于各项业务提供的相关服务完成时确认收入。

#### ④资产管理业务净收入

资产管理业务中，定向资产管理业务于委托资产管理合同到期与委托单位结算收益或损失时，按合同约定计算确认收入；集合资产管理业务每月按受托资产规模和合同约定的费率计算确认收入。

#### ⑤投资咨询业务净收入

在与交易相关的经济利益能够流入企业，收入的金额能够可靠地计量时，按合同或协议规定确认为收入。

### （2）利息净收入

在与交易相关的经济利益能够流入企业，收入的金额能够可靠地计量时，按资金使用时间和约定的利率确认收入；融资融券业务根据与客户合约的约定，按出借资金或证券的时间和约定利率确认收入；买入返售证券收入在当期到期返售的，按返售价格与买入成本之间的实际差额确认为当期收入，在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期收入。

### （3）投资收益

公司持有金融资产期间取得的红利、股息或现金股利等，计入当期损益；处置金融资产时，按取得的价款与账面价值之间的差额，计入当期损益，同时，调整公允价值变动损益或将原直接计入资本公积的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资损益。

采用成本法核算长期股权投资的，按被投资单位宣告发放的现金股利或利润中属于公司的部分确认当期损益；采用权益法核算长期股权投资的，按被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认当期损益。

### （4）公允价值变动损益

公司对以公允价值计量且其变动进入当期损益的金融资产或金融负债等在资产负债表

日因公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。出售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等时，将原计入该金融资产、金融负债的公允价值变动从公允价值变动损益转入投资收益。

#### (5) 其他业务收入

在与交易相关的经济利益能够流入企业，收入的金额能够可靠地计量时，按合同或协议规定确认为收入。

### 24、政府补助

政府补助，是本公司从政府无偿取得的货币性资产与非货币性资产。政府补助分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。

#### (1) 与资产相关的政府补助会计处理方法

与购建固定资产、无形资产等长期资产相关的政府补助，确认为递延收益，按照所建造或购买的资产使用年限分期计入营业外收入。

#### (2) 与收益相关的政府补助会计处理方法

与收益相关的政府补助，用于补偿企业以后期间的相关费用或损失的，取得时确认为递延收益，在确认相关费用的期间计入当期营业外收入；用于补偿企业已发生的相关费用或损失的，取得时直接计入当期营业外收入。

### 25、递延所得税资产和递延所得税负债

对于可抵扣暂时性差异确认递延所得税资产，以未来期间很可能取得的用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

对于应纳税暂时性差异，除特殊情况外，确认递延所得税负债。

不确认递延所得税资产或递延所得税负债的特殊情况包括：商誉的初始确认；除企业合并以外的发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的其他交易或事项。

当拥有以净额结算的法定权利，且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行时，当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列报。

当拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利，且递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同

的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债时，递延所得税资产及递延所得税负债以抵销后的净额列报。

## 26、经营租赁

### (1) 租入资产

公司租入资产所支付的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，计入当期费用。公司支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用。

资产出租方承担了应由公司承担的与租赁相关的费用时，公司将该部分费用从租金总额中扣除，按扣除后的租金费用在租赁期内分摊，计入当期费用。

### (2) 租出资产

公司出租资产所收取的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，确认为租赁收入。公司支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用；如金额较大的，则予以资本化，在整个租赁期间内按照与租赁收入确认相同的基础分期计入当期收益。

公司承担了应由承租方承担的与租赁相关的费用时，公司将该部分费用从租金收入总额中扣除，按扣除后的租金费用在租赁期内分配。

## 27、融资融券业务

公司融资融券业务中，将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。融出资金按借给客户资金的本金计量。

公司融资融券业务中，将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，此项业务融出的证券不满足终止确认条件，继续确认该金融资产；同时确认一项债权（融出证券）。

融资融券利息收入，根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

## 28、客户交易结算资金核算办法

公司代理客户买卖证券收到的代理买卖证券款，全额存入本公司指定的银行账户；公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。



公司接受客户委托通过证券交易所代理买卖证券，与客户清算时如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，加代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费减少客户交易结算资金；如买入证券成交总额小于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，减代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费增加客户交易结算资金。

## 29、资产管理业务核算办法

资产管理业务是指公司接受委托负责经营管理受托资产的业务，包括定向资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司受托经营定向资产管理业务独立核算。核算时按实际受托资产的款项，同时确认一项资产和一项负债；对受托管理的资产进行证券买卖，按代买卖证券业务的会计核算进行处理。公司受托集合资产管理业务，比照《证券投资基金会计核算办法》核算，独立建账，独立核算。不同集合资产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，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。

## 30、代理发行证券核算办法

### (1) 全额包销方式

在按承购价格购入待发售证券时，确认一项资产，公司将证券转售给投资者时，按承销价格确认为证券承销收入，按已承销证券的承购价格结转承销证券的成本。承销期结束后，如有未售出的证券，按承销价格转为公司的自营证券或长期投资。

### (2) 余额包销方式

公司在收到代发行人发售的证券时，只在专设的备查账簿中登记承销证券的情况。承销期结束后，如有未售出的证券，按约定的承销价格转为公司的自营证券或长期投资。代发行证券的手续费收入，在承销业务提供的相关服务完成时确认为收入。

### (3) 代销方式

公司在收到代发行人发售的证券时，只在专设的备查账簿中登记承销证券的情况。代发行证券的手续费收入，在承销业务提供的相关服务完成时确认为收入。

## 31、代理兑付债券核算办法

代理兑付债券业务是公司接受证券发行人的委托对其发行的债券到期进行债券兑付的业务。代理兑付债券的手续费收入于代理兑付债券业务提供的相关服务完成时确认。

## 32、期货业务核算办法

### (1) 质押品的管理与核算方法

公司接受的质押品包括：交易所注册的标准仓单、在中国境内流通的已上市国债、外币现钞。上述凭证必须在凭证的有效期限内。

质押品是交易所注册的标准仓单，按各交易所质押金额计算方法规定办理。

质押品是上市国债、外币现钞的，按人民银行公布的市价、牌价确定其基价市值，但质押额不高于其市值的70%。

### (2) 实物交割的核算方法

按交割月最后交易日的结算价核算，每月清算，月底无余额。

## 33、套期会计

### (1) 套期保值的分类

本公司将套期分为公允价值套期、现金流量套期和境外经营净投资套期。

①公允价值套期，是指对已确认资产或负债，尚未确认的确定承诺（除外汇风险外）的公允价值变动风险进行的套期。

②现金流量套期，是指对现金流量变动风险进行的套期，此现金流量变动源于与已确认资产或负债、很可能发生的预期交易有关的某类特定风险，或一项未确认的确定承诺包含的外汇风险。

③境外经营净投资套期，是指对境外经营净投资外汇风险进行的套期。境外经营净投资，是指企业在境外经营净资产中的权益份额。

### (2) 套期关系的指定及套期有效性的认定

在套期关系开始时，本公司对套期关系有正式指定，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。该文件载明了套期工具、被套期项目或交易，被套期风险的性质，以及本公司对套期工具有效性评价方法。

套期有效性，是指套期工具的公允价值或现金流量变动能够抵销被套期风险引起的被套期项目公允价值或现金流量变动的程度。本公司持续地对套期有效性进行评价，判断该套期在套期关系被指定的会计期间内是否高度有效。套期同时满足下列条件时，本公司认定其为高度有效：

①在套期开始及以后期间，该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) 套期会计处理方法

#### ①公允价值套期

套期衍生工具的公允价值变动计入当期损益。被套期项目的公允价值因套期风险而形成的变动，计入当期损益，同时调整被套期项目的账面价值。

就与按摊余成本计量的金融工具有关的公允价值套期而言，对被套期项目账面价值所作的调整，在调整日至到期日之间的剩余期间内进行摊销，计入当期损益。按照实际利率法的摊销可于账面价值调整后随即开始，并不得晚于被套期项目终止针对套期风险产生的公允价值变动而进行的调整。

如果被套期项目终止确认，则将未摊销的公允价值确认为当期损益。

被套期项目为尚未确认的确定承诺的，该确定承诺的公允价值因被套期风险引起的累计公允价值变动确认为一项资产或负债，相关的利得或损失计入当期损益。套期工具的公允价值变动亦计入当期损益。

#### ②现金流量套期

套期工具利得或损失中属于有效套期的部分，直接确认为资本公积（其他资本公积），属于无效套期的部分，计入当期损益。

如果被套期交易影响当期损益的，如当被套期财务收入或财务费用被确认或预期销售发生时，则将资本公积（其他资本公积）中确认的金额转入当期损益。如果被套期项目是一项非金融资产或非金融负债的成本，则原在资本公积（其他资本公积）中确认的金额转出，计入该非金融资产或非金融负债的初始确认金额（或则原在资本公积（其他资本公积）中确认的，在该非金融资产或非金融负债影响损益的相同期间转出，计入当期损益）。

如果预期交易或确定承诺预计不会发生，则以前计入股东权益中的套期工具累计利得或损失转出，计入当期损益。如果套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使(但并未被替换或展期)，或者撤销了对套期关系的指定，则以前计入其他综合收益的金额不转出，直至预期交易或确定承诺影响当期损益。

#### ③境外经营净投资套期

对境外经营净投资的套期，包括作为净投资的一部分的货币性项目的套期，其处理与现金流量套期类似。套期工具的利得或损失中被确定为有效套期的部分计入其他综合收益，而无效套期的部分确认为当期损益。处置境外经营时，任何计入股东权益的累计利得或损失转出，计入当期损益。

### 34、关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成本公司的关联方。

本公司的关联方包括但不限于：

- (1) 本公司的母公司；
- (2) 本公司的子公司；
- (3) 与本公司受同一母公司控制的其他企业；
- (4) 对本公司实施共同控制的投资方；
- (5) 对本公司施加重大影响的投资方；
- (6) 本公司的合营企业，包括合营企业的子公司；
- (7) 本公司的联营企业，包括联营企业的子公司；
- (8) 本公司的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员；
- (9) 本公司或其母公司的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员；
- (10) 本公司的主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制的其他企业。

### 35、重要会计政策和会计估计的变更

- (1) 重要会计政策变更

本报告期未发生重要会计政策变更。

- (2) 重要会计估计变更

本报告期未发生重要会计估计变更。

## 四、税项

### 1、主要税种和税率及税收优惠

| 税 种     | 计税依据   | 税 率       |
|---------|--------|-----------|
| 增值税     | 应税增值额  | 6%        |
| 企业所得税   | 应纳税所得额 | 25%、16.5% |
| 城市维护建设税 | 应缴流转税  | 7%        |

本公司子公司存在不同企业所得税税率的情况

| 纳税主体名称       | 所得税税率 |
|--------------|-------|
| 国元证券（香港）有限公司 | 16.5% |

注：国元香港按应课税盈利的 16.5% 计提缴纳香港利得税。

### 2、其他税项

按国家和地方有关规定计算缴纳。

### 五、合并财务报表项目注释

美元 2017 年 6 月 30 日的折算率为 6.7744，2016 年 12 月 31 日的折算率为 6.9370；港币 2017 年 6 月 30 日的折算率为 0.86792，2016 年 12 月 31 日的折算率为 0.8945。

#### 1、货币资金

| 项 目     | 期末余额             |                          | 期初余额             |                          |
|---------|------------------|--------------------------|------------------|--------------------------|
|         | 外币金额             | 折人民币金额                   | 外币金额             | 折人民币金额                   |
| 库存现金    |                  |                          |                  |                          |
| 人民币     | —                | 768,475.91               | —                | 536,488.29               |
| 港 币     | 51,115.61        | 44,364.26                | 64,966.00        | 58,112.09                |
| 小 计     | —                | <b>812,840.17</b>        | —                | <b>594,600.38</b>        |
| 银行存款    |                  |                          |                  |                          |
| 其中：客户资金 |                  |                          |                  |                          |
| 人民币     | —                | 10,702,464,773.76        | —                | 11,522,869,358.62        |
| 美 元     | 74,256,780.37    | 503,045,132.96           | 12,439,052.49    | 86,289,707.11            |
| 港 币     | 1,641,941,250.21 | 1,425,073,649.84         | 2,306,092,144.61 | 2,062,799,757.45         |
| 小 计     | —                | <b>12,630,583,556.56</b> | —                | <b>13,671,958,823.18</b> |
| 自有资金    |                  |                          |                  |                          |

|        |                |                          |                |                          |
|--------|----------------|--------------------------|----------------|--------------------------|
| 人民币    | —              | 3,830,541,196.90         | —              | 3,860,918,005.82         |
| 美元     | 8,090,834.61   | 54,810,549.97            | 141,538.96     | 981,855.77               |
| 港币     | 218,432,664.49 | 189,582,078.17           | 580,498,326.81 | 519,255,776.10           |
| 小计     | —              | <b>4,074,933,825.04</b>  | —              | <b>4,381,155,637.69</b>  |
| 其他货币资金 | —              | <b>9,753,978.74</b>      | —              | <b>38,081,535.93</b>     |
| 合计     | —              | <b>16,716,084,200.51</b> | —              | <b>18,091,790,597.18</b> |

其中，融资融券业务：

| 项目     | 期末余额             |                         | 期初余额             |                         |
|--------|------------------|-------------------------|------------------|-------------------------|
|        | 外币金额             | 折人民币金额                  | 外币金额             | 折人民币金额                  |
| 客户信用资金 |                  |                         |                  |                         |
| 人民币    | —                | 1,571,958,077.32        | —                | 1,333,556,368.59        |
| 港币     | 1,548,860,336.60 | 1,344,286,863.34        | 1,476,057,782.00 | 1,320,333,686.00        |
| 小计     | —                | <b>2,916,244,940.66</b> | —                | <b>2,653,890,054.59</b> |
| 自有信用资金 |                  |                         |                  |                         |
| 人民币    | —                | <b>107,509,443.97</b>   | —                | <b>32,950,751.25</b>    |
| 合计     | —                | <b>3,023,754,384.63</b> | —                | <b>2,686,840,805.84</b> |

期末货币资金中被冻结的金额为 600 万元。除此之外，期末货币资金中无其他因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

## 2、结算备付金

| 项目       | 期末余额          |                         | 期初余额          |                         |
|----------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|
|          | 外币金额          | 折人民币金额                  | 外币金额          | 折人民币金额                  |
| 客户备付金    |               |                         |               |                         |
| 人民币      | —             | 2,656,518,488.22        | —             | 2,534,395,075.19        |
| 美元       | 10,082,238.04 | 68,301,113.38           | 11,676,513.52 | 80,999,974.29           |
| 港币       | 39,577,213.77 | 34,349,855.38           | 43,756,469.68 | 39,140,599.69           |
| 小计       | —             | <b>2,759,169,456.98</b> | —             | <b>2,654,535,649.17</b> |
| 其中：信用备付金 | —             | 394,589,317.16          | —             | 592,880,726.21          |
| 自有备付金    |               |                         |               |                         |

|          |   |                         |   |                         |
|----------|---|-------------------------|---|-------------------------|
| 人民币      | — | 376,587,807.44          | — | 271,220,634.92          |
| 其中：信用备付金 | — | 19,778,599.87           | — | 19,500,767.86           |
| 合计       | — | <b>3,135,757,264.42</b> | — | <b>2,925,756,284.09</b> |

### 3、融出资金

#### (1) 按类别列示

| 项目         | 期末余额                     | 期初余额                     |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 融资融券业务融出资金 | 11,121,135,593.16        | 10,656,533,533.11        |
| 孖展融资       | 2,234,626,663.25         | 1,624,358,940.94         |
| 合计         | <b>13,355,762,256.41</b> | <b>12,280,892,474.05</b> |
| 减：减值准备     | 55,750,772.98            | 53,427,762.67            |
| 账面价值       | <b>13,300,011,483.43</b> | <b>12,227,464,711.38</b> |

#### (2) 按账龄列示

| 账龄    | 期末余额                     |               |                      |             | 账面价值                     |
|-------|--------------------------|---------------|----------------------|-------------|--------------------------|
|       | 账面余额                     |               | 减值准备                 |             |                          |
|       | 金额                       | 比例(%)         | 金额                   | 计提比例(%)     |                          |
| 1—3个月 | 4,532,418,380.22         | 33.94         | 11,634,782.72        | 0.26        | 4,520,783,597.50         |
| 3—6个月 | 8,688,318,484.53         | 65.05         | 43,441,592.42        | 0.50        | 8,644,876,892.11         |
| 6个月以上 | 135,025,391.66           | 1.01          | 674,397.84           | 0.50        | 134,350,993.82           |
| 合计    | <b>13,355,762,256.41</b> | <b>100.00</b> | <b>55,750,772.98</b> | <b>0.42</b> | <b>13,300,011,483.43</b> |

(续上表)

| 账龄    | 期初余额                     |               |                      |             | 账面价值                     |
|-------|--------------------------|---------------|----------------------|-------------|--------------------------|
|       | 账面余额                     |               | 减值准备                 |             |                          |
|       | 金额                       | 比例(%)         | 金额                   | 计提比例(%)     |                          |
| 1—3个月 | 7,611,126,151.62         | 61.97         | 29,933,836.05        | 0.39        | 7,581,192,315.57         |
| 3—6个月 | 1,685,720,602.90         | 13.73         | 8,428,603.01         | 0.50        | 1,677,291,999.89         |
| 6个月以上 | 2,984,045,719.53         | 24.30         | 15,065,323.61        | 0.50        | 2,968,980,395.92         |
| 合计    | <b>12,280,892,474.05</b> | <b>100.00</b> | <b>53,427,762.67</b> | <b>0.44</b> | <b>12,227,464,711.38</b> |

(3) 按客户列示

| 项 目        | 期末余额                     | 期初余额                     |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 个 人        | 12,995,463,971.00        | 11,309,687,746.32        |
| 机 构        | 360,298,285.41           | 971,204,727.73           |
| <b>合 计</b> | <b>13,355,762,256.41</b> | <b>12,280,892,474.05</b> |

(4) 融出资金担保物情况

| 担保物类别      | 期末公允价值                   | 期初公允价值                   |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 资 金        | 993,996,187.13           | 1,884,940,405.35         |
| 基 金        | 719,482,011.87           | 61,039,115.41            |
| 股 票        | 32,568,343,233.23        | 36,659,133,256.81        |
| 债 券        | —                        | —                        |
| <b>合 计</b> | <b>34,281,821,432.23</b> | <b>38,605,112,777.57</b> |

(5) 期末已逾期的融出资金余额为 145,824.13 元，公司已全额计提坏账准备。

4、 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 按类别列示

| 项 目  | 期末余额             |                  | 期初余额             |                  |
|--|------------------|------------------|------------------|------------------|
|  | 账面余额             | 初始成本             | 账面余额             | 初始成本             |
| <b>交易性金融资产</b>                             | 1,290,128,720.17 | 1,273,013,471.33 | 1,312,644,232.54 | 1,317,539,375.19 |
| 其中：债 券                                     | 156,376,619.44   | 155,346,957.82   | 118,383,963.97   | 118,939,932.58   |
| 基 金  | 327,295,931.61   | 321,440,538.08   | 695,830,122.41   | 702,863,246.73   |
| 股 票  | 773,156,169.12   | 762,925,975.43   | 492,422,278.16   | 489,728,327.88   |
| 信托产品                                       | 6,000,000.00     | 6,000,000.00     |                  |                  |
| 银行理财产品                                     | 27,300,000.00    | 27,300,000.00    | 6,007,868.00     | 6,007,868.00     |
| <b>指定为以公允价值计<br/>量且其变动计入当期<br/>损益的金融资产</b> |                  |                  | —                | —                |
| 其中：债 券                                     |                  |                  | —                | —                |
| 基 金  |                  |                  | —                | —                |
| 股 票  |                  |                  | —                | —                |
| 银行理财产品                                     |                  |                  | —                | —                |



|     |                  |                  |                  |                  |
|-----|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 合 计 | 1,290,128,720.17 | 1,273,013,471.33 | 1,312,644,232.54 | 1,317,539,375.19 |
|-----|------------------|------------------|------------------|------------------|

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无融出证券情况。

(3) 有承诺条件的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

| 项 目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 期末账面余额        |
|-----|------------------|---------------|
| 债 券 | 作为卖出回购的质押物       | 36,750,000.00 |

### 5、衍生金融资产

| 类 别         | 期末余额          |      |               |       |      |    |
|-------------|---------------|------|---------------|-------|------|----|
|             | 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 |    |
|             |               | 资产   | 负债            |       | 资产   | 负债 |
| 其他衍生工具      | —             | —    | —             | —     | —    | —  |
| 股指期货合约      | 27,700,680.00 | —    | 1,003,160.00  |       |      | —  |
| 减：可抵消的暂收暂付款 | —             | —    | -1,003,160.00 |       |      | —  |
| 合 计         | 27,700,680.00 | —    | —             |       |      | —  |

(续上表)

| 类 别         | 期初余额 |      |    |                |               |    |
|-------------|------|------|----|----------------|---------------|----|
|             | 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          |    |
|             |      | 资产   | 负债 |                | 资产            | 负债 |
| 其他衍生工具      | —    | —    | —  | —              | —             | —  |
| 股指期货合约      | —    | —    | —  | 128,495,541.35 | 1,557,300.00  | —  |
| 减：可抵消的暂收暂付款 | —    | —    | —  | —              | -1,557,300.00 | —  |
| 合 计         | —    | —    | —  | 128,495,541.35 | —             | —  |

### 6、买入返售金融资产

(1) 按金融资产种类列示

| 项 目 | 期末余额             | 期初余额             |
|-----|------------------|------------------|
| 股 票 | 6,929,534,226.47 | 5,823,924,885.96 |
| 债 券 | 982,256,204.05   | 584,708,235.00   |

|             |                         |                         |
|-------------|-------------------------|-------------------------|
| 其中：国债       | 982,256,204.05          | 584,708,235.00          |
| 金融债         |                         | —                       |
| 公司债         |                         | —                       |
| <b>合 计</b>  | <b>7,911,790,430.52</b> | <b>6,408,633,120.96</b> |
| 减：减值准备      | 69,295,342.27           | 57,131,248.86           |
| <b>账面价值</b> | <b>7,842,495,088.25</b> | <b>6,351,501,872.10</b> |

(2) 按业务类别列示

| 项 目        | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 约定购回式证券    | 297,609,764.73          | 749,443,236.68          |
| 债券质押式回购    | 982,256,204.05          | 584,708,235.00          |
| 股票质押式回购    | 6,631,924,461.74        | 5,074,481,649.28        |
| <b>合 计</b> | <b>7,911,790,430.52</b> | <b>6,408,633,120.96</b> |

(3) 约定购回式证券、股票质押式回购等的剩余期限

①约定购回融出资金剩余期限

| 期 限        | 期末余额                  | 期初余额                  |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 1 个月以内     | 4,276,800.00          | 202,236,610.24        |
| 1—3 个月     | 274,507,159.00        | 244,142,805.00        |
| 3 个月—1 年   | 18,825,805.73         | 303,063,821.44        |
| 1 年以上      | —                     | —                     |
| <b>合 计</b> | <b>297,609,764.73</b> | <b>749,443,236.68</b> |

②股票质押回购融出资金剩余期限

| 期 限        | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 1 个月以内     | 28,924,983.54           | 97,496,591.36           |
| 1—3 个月     | 202,770,672.58          | 80,036,120.00           |
| 3 个月—1 年   | 3,621,363,423.90        | 1,549,631,141.72        |
| 1 年以上      | 2,778,865,381.72        | 3,347,317,796.20        |
| <b>合 计</b> | <b>6,631,924,461.74</b> | <b>5,074,481,649.28</b> |

(4) 买入返售金融资产的担保物信息

①约定购回式证券收取的担保物情况

| 担保物类别      | 期末公允价值                | 期初公允价值                  |
|------------|-----------------------|-------------------------|
| 股 票        | 505,337,566.76        | 1,646,458,961.89        |
| 债 券        |                       | —                       |
| 其 他        |                       | —                       |
| <b>合 计</b> | <b>505,337,566.76</b> | <b>1,646,458,961.89</b> |

②股票质押式回购收取的担保物情况

| 担保物类别      | 期末公允价值                   | 期初公允价值                   |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 股 票        | 15,013,229,123.12        | 15,142,977,020.54        |
| 债 券        |                          | —                        |
| 其 他        |                          | —                        |
| <b>合 计</b> | <b>15,013,229,123.12</b> | <b>15,142,977,020.54</b> |

7、应收款项

(1) 按明细列示

| 项 目             | 期末余额                  | 期初余额                  |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 应收款项            | 398,193,216.84        | 670,445,265.33        |
| 减：坏账准备          | 17,626,387.22         | 16,939,362.07         |
| <b>应收款项账面价值</b> | <b>380,566,829.62</b> | <b>653,505,903.26</b> |

(2) 按账龄列示

| 账 龄        | 期末余额                  |            |                      |             | 账面价值                  |
|------------|-----------------------|------------|----------------------|-------------|-----------------------|
|            | 账面余额                  |            | 坏账准备                 |             |                       |
|            | 金 额                   | 比例 (%)     | 金 额                  | 计提比例 (%)    |                       |
| 1年以内       | 380,864,151.33        | 95.65      | 3,815,073.99         | 1.00        | 377,049,077.34        |
| 1—2年       | 1,379,065.75          | 0.35       | 137,906.58           | 10.00       | 1,241,159.17          |
| 2—3年       | 1,414,746.20          | 0.36       | 282,949.24           | 20.00       | 1,131,796.96          |
| 3—4年       | 1,227,831.63          | 0.31       | 613,915.82           | 50.00       | 613,915.81            |
| 4—5年       | 2,654,401.69          | 0.67       | 2,123,521.35         | 80.00       | 530,880.34            |
| 5年以上       | 10,653,020.24         | 2.66       | 10,653,020.24        | 100.00      | -                     |
| <b>合 计</b> | <b>398,193,216.84</b> | <b>100</b> | <b>17,626,387.22</b> | <b>4.43</b> | <b>380,566,829.62</b> |

(续上表)

| 账 龄  | 期初余额                  |               |                      |             | 账面价值                  |
|------|-----------------------|---------------|----------------------|-------------|-----------------------|
|      | 账面余额                  |               | 坏账准备                 |             |                       |
|      | 金 额                   | 比例 (%)        | 金 额                  | 计提比例 (%)    |                       |
| 1年以内 | 648,775,812.73        | 96.77         | 1,619,255.82         | 0.25        | 647,156,556.91        |
| 1—2年 | 4,289,858.23          | 0.64          | 428,985.82           | 10.00       | 3,860,872.41          |
| 2—3年 | 3,664,054.46          | 0.55          | 2,418,174.97         | 66.00       | 1,245,879.49          |
| 3—4年 | 1,966,207.47          | 0.29          | 983,103.74           | 50.00       | 983,103.73            |
| 4—5年 | 1,297,453.59          | 0.19          | 1,037,962.87         | 80.00       | 259,490.72            |
| 5年以上 | 10,451,878.85         | 1.56          | 10,451,878.85        | 100.00      | —                     |
| 合 计  | <b>670,445,265.33</b> | <b>100.00</b> | <b>16,939,362.07</b> | <b>2.53</b> | <b>653,505,903.26</b> |

(3) 分类披露

①期末单项金额重大并单项计提坏账准备的应收账款

| 单位名称             | 款项内容        | 账面余额           | 坏账金额 | 计提比例 (%) | 计提理由 |
|------------------|-------------|----------------|------|----------|------|
| 中国证券登记结算有限公司     | T+1 清算款     | 199,783,627.24 | —    | —        |      |
| 香港交易所清算款         | 清算款         | 84,779,044.32  | —    | —        |      |
| 北京和丰永讯金融信息服务有限公司 | 预付金融服<br>务款 | 20,000,000.00  | —    | —        |      |
| 合 计              |             | 304,562,671.56 | —    | —        |      |

②组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的应收款项

| 账 龄  | 期末余额          |        |              |          | 账面价值          |
|------|---------------|--------|--------------|----------|---------------|
|      | 账面余额          |        | 坏账准备         |          |               |
|      | 金 额           | 比例 (%) | 金 额          | 计提比例 (%) |               |
| 1年以内 | 76,301,479.77 | 81.49  | 3,815,073.99 | 5.00     | 72,486,405.78 |
| 1—2年 | 1,379,065.75  | 1.47   | 137,906.58   | 10.00    | 1,241,159.17  |
| 2—3年 | 1,414,746.20  | 1.51   | 282,949.24   | 20.00    | 1,131,796.96  |
| 3—4年 | 1,227,831.63  | 1.31   | 613,915.82   | 50.00    | 613,915.81    |
| 4—5年 | 2,654,401.69  | 2.83   | 2,123,521.35 | 80.00    | 530,880.34    |

|      |               |       |               |        |               |
|------|---------------|-------|---------------|--------|---------------|
| 5年以上 | 10,653,020.24 | 11.39 | 10,653,020.24 | 100.00 | -             |
| 合计   | 93,630,545.28 | 100   | 17,626,387.22 | 18.83  | 76,004,158.06 |

(续上表)

| 账龄   | 期初余额                 |               |                      |              | 账面价值                 |
|------|----------------------|---------------|----------------------|--------------|----------------------|
|      | 账面余额                 |               | 坏账准备                 |              |                      |
|      | 金额                   | 比例(%)         | 金额                   | 计提比例(%)      |                      |
| 1年以内 | 32,385,116.28        | 62.34         | 1,619,255.82         | 5.00         | 30,765,860.46        |
| 1—2年 | 4,289,858.23         | 8.26          | 428,985.82           | 10.00        | 3,860,872.41         |
| 2—3年 | 1,557,349.36         | 3.00          | 311,469.87           | 20.00        | 1,245,879.49         |
| 3—4年 | 1,966,207.47         | 3.78          | 983,103.74           | 50.00        | 983,103.73           |
| 4—5年 | 1,297,453.59         | 2.50          | 1,037,962.87         | 80.00        | 259,490.72           |
| 5年以上 | 10,451,878.85        | 20.12         | 10,451,878.85        | 100.00       | —                    |
| 合计   | <b>51,947,863.78</b> | <b>100.00</b> | <b>14,832,656.97</b> | <b>28.55</b> | <b>37,115,206.81</b> |

③期末单项金额不重大但单项计提坏账准备的应收款项：无

(4) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

本期计提坏账准备金额 2,793,730.25 元，安徽华安达集团工艺品有限公司去年底全额计提的坏账准备 2,106,705.10 元本报告期转回（应收账款全额收到）。

(5) 应收款项期末余额较期初下降 41.77%，主要系本报告期末应收证券清算款减少所致。

## 8、应收利息

(1) 应收利息分类

| 项目     | 期末余额           | 期初余额           |
|--------|----------------|----------------|
| 债券投资   | 607,025,072.33 | 518,770,244.91 |
| 融资融券   | 166,846,674.74 | 128,188,117.88 |
| 买入返售   | 62,842,864.84  | 72,174,227.95  |
| 信托     | 27,040,621.28  | 5,945,030.97   |
| 存放金融同业 | 10,794,944.87  | 3,556,487.56   |
| 资管计划红利 |                | 17,948,959.00  |

|            |                       |                       |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 其他         | 3,115,544.88          |                       |
| <b>合 计</b> | <b>877,665,722.94</b> | <b>746,583,068.27</b> |

(2) 期末应收利息余额中无逾期应收利息。

### 9、存出保证金

| 项 目        | 期末余额                 | 期初余额                 |
|------------|----------------------|----------------------|
| 交易保证金      | 31,861,395.58        | 32,294,688.50        |
| 结算担保金      | 16,589,217.45        | 10,398,390.97        |
| <b>合 计</b> | <b>48,450,613.03</b> | <b>42,693,079.47</b> |

### 10、可供出售金融资产

(1) 按投资品种类别列示

| 项 目             | 期末余额                     |                       |                          |                      |                          |
|-----------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------|----------------------|--------------------------|
|                 | 初始成本                     | 公允价值变动                | 账面余额                     | 减值准备                 | 账面价值                     |
| <b>按公允价值计量:</b> |                          |                       |                          |                      |                          |
| 债 券             | 20,808,222,231.38        | 19,825,471.06         | 20,828,047,702.44        |                      | 20,828,047,702.44        |
| 基 金             | 229,455,212.11           | -766,142.96           | 228,689,069.15           | 65,885.00            | 228,623,184.15           |
| 股 票             | 192,690,169.44           | 197,200,926.25        | 389,891,095.69           | 94,894.32            | 389,796,201.37           |
| 证券公司理财产品        | 926,913,813.99           | 40,457,786.03         | 967,371,600.02           | 956,703.10           | 966,414,896.92           |
| 其他权益工具          | 615,295,329.18           | 279,247,760.36        | 894,543,089.54           | 30,465,000.00        | 864,078,089.54           |
| <b>按成本计量:</b>   |                          |                       |                          |                      |                          |
| 信托计划            | 1,539,200,000.00         |                       | 1,539,200,000.00         |                      | 1,539,200,000.00         |
| 权益工具            | 284,579,625.76           |                       | 284,579,625.76           | 433,209.60           | 284,146,416.16           |
| <b>合 计</b>      | <b>24,596,356,381.86</b> | <b>535,965,800.74</b> | <b>25,132,322,182.60</b> | <b>32,015,692.02</b> | <b>25,100,306,490.58</b> |

(续上表)

| 项 目             | 期初余额              |                |                   |               |                   |
|-----------------|-------------------|----------------|-------------------|---------------|-------------------|
|                 | 初始成本              | 公允价值变动         | 账面余额              | 减值准备          | 账面价值              |
| <b>按公允价值计量:</b> |                   |                |                   |               |                   |
| 债 券             | 16,355,413,503.34 | 182,716,559.36 | 16,538,130,062.70 | —             | 16,538,130,062.70 |
| 基 金             | 344,674,006.76    | 9,455,355.47   | 354,129,362.23    | 65,885.00     | 354,063,477.23    |
| 股 票             | 319,990,452.09    | 154,733,346.37 | 474,723,798.46    | 23,192,792.50 | 451,531,005.96    |

|               |                          |                       |                          |                      |                          |
|---------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------|----------------------|--------------------------|
| 证券公司理财产品      | 790,826,445.82           | 26,718,919.77         | 817,545,365.59           | 4,534,293.10         | 813,011,072.49           |
| 银行理财产品        | 74,000,000.00            | —                     | 74,000,000.00            | —                    | 74,000,000.00            |
| 收益互换产品        | 3,677,620,000.00         | 30,873,311.83         | 3,708,493,311.83         | —                    | 3,708,493,311.83         |
| 其他权益工具        | 705,311,329.18           | 283,386,156.64        | 988,697,485.82           | 30,465,000.00        | 958,232,485.82           |
| <b>按成本计量:</b> |                          |                       |                          |                      |                          |
| 信托计划          | 1,849,200,000.00         | —                     | 1,849,200,000.00         | —                    | 1,849,200,000.00         |
| 权益工具          | 298,979,625.76           | —                     | 298,979,625.76           | 433,209.60           | 298,546,416.16           |
| <b>合计</b>     | <b>24,416,015,362.95</b> | <b>687,883,649.44</b> | <b>25,103,899,012.39</b> | <b>58,691,180.20</b> | <b>25,045,207,832.19</b> |

## (2) 可供出售金融资产中已融出证券情况

| 项 目         | 期末公允价值               | 期初公允价值               |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 融出证券        | 32,155,863.45        | 69,480,537.94        |
| 减: 减值准备     | 160,779.32           | 347,402.69           |
| <b>账面价值</b> | <b>31,995,084.13</b> | <b>69,133,135.25</b> |

## (3) 已融出证券的担保情况

| 担保物类别      | 期末公允价值                | 期初公允价值                |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 资 金        | 49,602,798.54         | 12,068,893.96         |
| 基 金        | 2,225,722.37          | 1,851,369.93          |
| 股 票        | 86,352,721.99         | 199,209,707.49        |
| <b>合 计</b> | <b>138,181,242.90</b> | <b>213,129,971.38</b> |

## (4) 期末按成本计量的可供出售金融资产权益工具

| 被投资单位           | 账面余额                  |          |                      |                       |
|-----------------|-----------------------|----------|----------------------|-----------------------|
|                 | 期初余额                  | 本期增加     | 本期减少                 | 期末余额                  |
| 中证信用增进股份有限公司    | 200,000,000.00        | —        | —                    | 200,000,000.00        |
| 中证机构间报价系统股份有限公司 | 50,000,000.00         | —        | —                    | 50,000,000.00         |
| 证通股份有限公司        | 25,000,000.00         | —        | —                    | 25,000,000.00         |
| 其他股权投资          | 23,979,625.76         | —        | 14,400,000.00        | 9,579,625.76          |
| <b>合 计</b>      | <b>298,979,625.76</b> | <b>—</b> | <b>14,400,000.00</b> | <b>284,579,625.76</b> |

(续上表)

| 被投资单位           | 减值准备              |          |          |                   | 在被投资单位持股比例 (%) | 本期现金红利        |
|-----------------|-------------------|----------|----------|-------------------|----------------|---------------|
|                 | 期初余额              | 本期增加     | 本期减少     | 期末余额              |                |               |
| 中证信用增进股份有限公司    | —                 | —        | —        | —                 | 4.88           | 12,000,000.00 |
| 中证机构间报价系统股份有限公司 | —                 | —        | —        | —                 | 0.66           | —             |
| 证通股份有限公司        | —                 | —        | —        | —                 | 0.99           | —             |
| 其他股权投资          | 433,209.60        | —        | —        | 433,209.60        | —              | —             |
| <b>合计</b>       | <b>433,209.60</b> | <b>—</b> | <b>—</b> | <b>433,209.60</b> | <b>—</b>       | <b>—</b>      |

(5) 可供出售金融资产减值准备

| 期初余额          | 本期计提        | 本期减少 |               | 期末余额          |
|---------------|-------------|------|---------------|---------------|
|               |             | 转回   | 转销            |               |
| 58,691,180.20 | -186,623.37 | —    | 26,488,864.81 | 32,015,692.02 |

本公司对可供出售权益工具计提减值准备的标准为：资产负债表日，如果单项金额重大的某项可供出售金融资产的公允价值持续一年低于取得成本或已经低于取得成本的50%，可认定该可供出售金融资产已发生减值。

(6) 可供出售权益工具期末公允价值大幅下跌或持续下跌相关说明

| 可供出售权益工具项目     | 投资成本                  | 期末公允价值                | 公允价值相对于成本的下跌幅度 (%) | 持续下跌时间 (个月) | 已计提减值金额              | 未计提减值原因 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|-------------|----------------------|---------|
| 淮北矿业股份有限公司     | 163,800,000.00        | 151,708,600.00        | 7.38               | 不适用         | 26,380,000.00        |         |
| 国元黄山3号集合资产管理计划 | 3,396,177.13          | 3,495,345.50          | —                  | 不适用         | 956,703.10           |         |
| 河南三合皮革制品有限公司   | 35,150,000.00         | 31,065,000.00         | 11.62              | 不适用         | 4,085,000.00         |         |
| <b>合计</b>      | <b>202,346,177.13</b> | <b>186,268,945.50</b> |                    |             | <b>31,421,703.10</b> |         |

(7) 存在限售期限及其他变现有限制的可供出售金融资产情况

其他变现有限制的可供出售金融资产

| 项目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 期末公允价值           |
|----|------------------|------------------|
| 债券 | 作为卖出回购的质押物       | 8,987,899,865.84 |

11、融券业务



(1) 项目列示

| 项 目       | 期末公允价值        | 期初公允价值        |
|-----------|---------------|---------------|
| 融出证券      |               |               |
| -可供出售金融资产 | 32,155,863.45 | 69,480,537.94 |
| -转融通融入证券  |               | —             |
| 融出证券总额    | 32,155,863.45 | 69,480,537.94 |
| 减：减值准备    | 160,779.32    | 347,402.69    |
| 融出证券账面价值  | 31,995,084.13 | 69,133,135.25 |

(2) 本期融券业务无违约情况发生。

12、持有至到期投资

持有至到期投资情况

| 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          |
| 债 券 | 18,858,165.76 | —    | 18,858,165.76 | 19,435,696.00 | —    | 19,435,696.00 |

13、长期股权投资

(1) 按类别列示

| 项 目    | 期末余额             | 期初余额             |
|--------|------------------|------------------|
| 合营企业   | —                | —                |
| 联营企业   | 2,118,899,405.35 | 2,094,747,875.63 |
| 小计     | 2,118,899,405.35 | 2,094,747,875.63 |
| 减：减值准备 | —                | —                |
| 合 计    | 2,118,899,405.35 | 2,094,747,875.63 |

(2) 长期股权投资明细情况

| 被投资单位  | 期初余额 | 本期增减变动 |      |             |          |        |
|--------|------|--------|------|-------------|----------|--------|
|        |      | 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 |
| 一、合营企业 | —    | —      | —    | —           | —        | —      |
| 二、联营企业 |      |        |      |             |          |        |

|                         |                         |   |   |               |              |   |
|-------------------------|-------------------------|---|---|---------------|--------------|---|
| 长盛基金管理有限公司              | 461,909,305.00          | — | — | 31,193,726.38 | 4,094,234.32 | — |
| 安徽安元投资基金有限公司            | 1,314,360,406.26        | — | — | 1,651,605.83  | 72.08        | — |
| 安徽安元投资基金管理有限公司          | 18,918,865.94           | — | — | 4,447,128.00  |              | — |
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 299,559,298.43          | — | — | 1,624,763.11  |              | — |
| <b>小 计</b>              | <b>2,094,747,875.63</b> | — | — | 38,917,223.32 | 4,094,306.40 | — |
| <b>合 计</b>              | <b>2,094,747,875.63</b> | — | — | 38,917,223.32 | 4,094,306.40 | — |

（续上表）

| 被投资单位                   | 本期增减变动               |        |    | 期末余额                    | 减值准备期末余额 |
|-------------------------|----------------------|--------|----|-------------------------|----------|
|                         | 宣告发放现金股利或利润          | 计提减值准备 | 其他 |                         |          |
| <b>一、合营企业</b>           |                      |        |    |                         |          |
| <b>二、联营企业</b>           |                      |        |    |                         |          |
| 长盛基金管理有限公司              | 18,860,000.00        | —      | —  | 478,337,265.70          | —        |
| 安徽安元投资基金有限公司            |                      | —      | —  | 1,316,012,084.17        | —        |
| 安徽安元投资基金管理有限公司          |                      | —      | —  | 23,365,993.94           | —        |
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） |                      | —      | —  | 301,184,061.54          | —        |
| <b>小 计</b>              | <b>18,860,000.00</b> | —      | —  | <b>2,118,899,405.35</b> | —        |
| <b>合 计</b>              | <b>18,860,000.00</b> | —      | —  | <b>2,118,899,405.35</b> | —        |

## （3）联营企业基本情况

| 被投资单位名称        | 企业类型 | 注册地 | 法定代表人 | 业务性质             | 注册资本    | 本企业持股比例(%) | 本企业在被投资单位表决权比例(%) |
|----------------|------|-----|-------|------------------|---------|------------|-------------------|
| 长盛基金管理有限公司     | 有限公司 | 深圳  | 周兵    | 基金管理业务、发起设立基金    | 1.89 亿元 | 41.00      | 41.00             |
| 安徽安元投资基金有限公司   | 有限公司 | 合肥  | 蔡咏    | 股权投资、基金投资、投资顾问等  | 30 亿元   | 43.33      | 43.33             |
| 安徽安元投资基金管理有限公司 | 有限公司 | 合肥  | 刘振    | 受托管理股权投资基金、投资顾问等 | 5000 万元 | 30.00      | 30.00             |

|                         |      |    |     |                    |     |       |       |
|-------------------------|------|----|-----|--------------------|-----|-------|-------|
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 有限合伙 | 合肥 | 不适用 | 股权投资、投资管理<br>及投资咨询 | 不适用 | 21.90 | 21.90 |
|-------------------------|------|----|-----|--------------------|-----|-------|-------|

（续上表）

| 被投资单位名称                 | 期末资产总额           | 期末负债总额         | 期末净资产总额          | 本期营业收入总额       | 本期净利润         |
|-------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|---------------|
| 长盛基金管理有限公司              | 1,365,588,089.78 | 292,468,883.78 | 1,073,119,206.00 | 299,660,668.41 | 77,308,872.45 |
| 安徽安元投资基金有限公司            | 3,743,772,902.38 | 8,796,405.10   | 3,734,976,497.28 | 29,992,526.32  | 2,123,312.20  |
| 安徽安元投资基金管理有限公司          | 79,762,886.37    | 1,876,239.92   | 77,886,646.45    | 26,603,202.74  | 14,823,760.02 |
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 1,325,313,019.29 | 103,773.62     | 1,325,209,245.67 | 20,555,887.66  | 7,221,581.57  |

长盛基金管理有限公司系经中国证监会证监基金字[1999]6号《关于同意长盛基金管理有限公司开业的批复》批准设立的基金管理公司，注册资本为10,000万元，本公司出资比例为25%。2003年11月，本公司受让长江证券有限责任公司持有长盛基金管理有限公司的25%股权，并向安徽省创新投资有限公司转让持有长盛基金管理有限公司的1%股权。上述股权转让于2004年11月业经中国证券监督管理委员会批准。转让后本公司持有长盛基金管理有限公司的股权比例变更为49%。2007年7月，本公司将持有的长盛基金管理有限公司8%的股权转让给新加坡DBS Asset Management Limited，转让后仍持有其41%的股权。2008年5月，经中国证监会证监许可[2008]709号《关于核准长盛基金管理有限公司变更注册资本、注册地址、股东名称及修改公司章程的批复》，批准长盛基金管理有限公司盈余公积转增资本，注册资本变更为15,000万元。2014年2月12日，长盛基金管理有限公司通过第五届董事会第五十七次会议决议，批准公司未分配利润转增资本，注册资本变更为18,900万元。此次注册资本变更已在深圳市市场监督管理局备案，备案通知编号为[2014]82389008号。

安徽安元投资基金有限公司系由公司与安徽国元控股（集团）有限责任公司（以下简称“国元集团”）、安徽省交通控股集团有限公司、安徽省铁路建设投资基金有限公司、安徽国贸联创投资有限公司共同出资组建，于2015年7月17日经合肥市工商行政管理局核准注册成立，统一社会信用代码为913401003487227680，注册资本人民币300,000.00万元，实缴注册资本300,000.00万元，其中本公司实缴1,300,000,000.00元，持股比例43.33%。

安徽安元投资基金管理有限公司系由公司与国元集团、安徽省交通控股集团有限公司、安徽省铁路建设投资基金有限公司、安徽国贸联创投资有限公司、安徽省股权托管交易中心有限责任公司、黄山有限公司共同出资组建，于2015年7月27日经合肥市工商行政管理局核准注册成立，统一社会信用代码为9134010033642064XL，注册资本人民币5,000.00万元，其中本公司出资1,500万元，持股比例30%。

合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙）系由国元直投与中电科国元（北京）产业投资基金管理有限公司、中电科投资控股有限公司、华本投资有限公司、安徽和合投资有限公司、国元农业保险股份有限公司、中兵投资管理有限责任公司、安徽国元信托有限责任公司、安徽国元投资有限责任公司、华元金控资本管理（上海）有限公司、上海长江财富资产管理有限公司共同出资组建，于2016年7月21日经合肥市包河区市场监督管理局核准注册成立，统一社会信用代码为91340111MA2MXMGR37，首期出资额为13.7亿元，其中国元直投出资3亿元，占认缴出资额的21.90%。

#### 14、固定资产

##### （1）账面价值

| 项 目               | 期末余额                    | 期初余额                    |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 固定资产原价            | 2,024,564,992.02        | 2,014,734,233.29        |
| 减：累计折旧            | 622,173,190.70          | 583,784,347.59          |
| 固定资产减值准备          | 382,615.47              | 382,615.47              |
| <b>固定资产账面价值合计</b> | <b>1,402,009,185.85</b> | <b>1,430,567,270.23</b> |

##### （2）固定资产增减变动情况

| 项 目       | 房屋及建筑物           | 机械及动力设备       | 电子及办公设备        | 运输设备          | 合计               |
|-----------|------------------|---------------|----------------|---------------|------------------|
| 一、账面原值：   |                  |               |                |               |                  |
| 1.期初余额    | 1,560,101,079.17 | 19,840,630.14 | 366,881,943.97 | 67,910,580.01 | 2,014,734,233.29 |
| 2.本期增加金额  | -                | 196,833.05    | 10,050,171.72  | 7,886,156.83  | 18,133,161.60    |
| （1）购置     | -                | 196,833.05    | 9,955,185.05   | 7,886,156.83  | 18,038,174.93    |
| （2）在建工程转入 | -                | -             | 94,986.67      | -             | 94,986.67        |
| （3）企业合并增加 | —                | —             | —              | —             | —                |
| （4）其他增加   | —                | —             | —              | —             | —                |

|            |                  |               |                |               |                  |
|------------|------------------|---------------|----------------|---------------|------------------|
| 3.本期减少金额   | -                | 84,000.00     | 1,904,737.00   | 5,473,752.17  | 7,462,489.17     |
| (1) 转让和出售  | —                | —             | —              | —             | —                |
| (2) 清理报废   | -                | 84,000.00     | 1,904,737.00   | 5,473,752.17  | 7,462,489.17     |
| (3) 其他减少   | —                | —             | —              | —             | —                |
| 4.外币报表折算差异 | -159,907.32      | -             | -606,181.77    | -73,824.61    | -839,913.70      |
| 5.期末余额     | 1,559,941,171.85 | 19,953,463.19 | 374,421,196.92 | 70,249,160.06 | 2,024,564,992.02 |
| 二、累计折旧     |                  |               |                |               |                  |
| 1.期初余额     | 288,948,345.20   | 9,812,723.96  | 248,789,064.88 | 36,234,213.55 | 583,784,347.59   |
| 2.本期增加金额   | 19,033,136.31    | 1,049,280.61  | 20,713,743.88  | 4,064,125.00  | 44,860,285.80    |
| (1) 计提     | 19,033,136.31    | 1,049,280.61  | 20,713,743.88  | 4,064,125.00  | 44,860,285.80    |
| (2) 企业合并增加 | —                | —             | —              | —             | —                |
| 3.本期减少金额   | -                | 59,041.64     | 1,824,272.53   | 3,978,418.67  | 5,861,732.84     |
| 4.外币报表折算差异 | -104,483.16      | -             | -488,495.15    | -16,731.54    | -609,709.85      |
| 5.期末余额     | 307,876,998.35   | 10,802,962.93 | 267,190,041.08 | 36,303,188.34 | 622,173,190.70   |
| 三、减值准备     |                  |               |                |               |                  |
| 1.期初余额     | —                | 230,101.78    | 110,758.71     | 41,754.98     | 382,615.47       |
| 2.本期增加金额   | —                | —             | —              | —             | —                |
| (1) 计提     | —                | —             | —              | —             | —                |
| (2) 企业合并增加 | —                | —             | —              | —             | —                |
| 3.本期减少金额   | —                | —             | —              | —             | —                |
| 4.外币报表折算差异 | —                | —             | —              | —             | —                |
| 5.期末余额     | —                | 230,101.78    | 110,758.71     | 41,754.98     | 382,615.47       |
| 四、账面价值     |                  |               |                |               |                  |
| 1.期末账面价值   | 1,252,064,173.50 | 8,920,398.48  | 107,120,397.13 | 33,904,216.74 | 1,402,009,185.85 |
| 2.期初账面价值   | 1,271,152,733.97 | 9,797,804.40  | 117,982,120.38 | 31,634,611.48 | 1,430,567,270.23 |

(3) 期末固定资产中无抵押、担保或其他所有权受到限制的情况。

## 15、在建工程

(1) 在建工程情况

| 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                 |
| 滨湖商用营业职场 | 42,498,235.56        | —    | 42,498,235.56        | 42,498,235.56        | —    | 42,498,235.56        |
| 零星工程     | 32,939,308.84        | —    | 32,939,308.84        | 28,685,496.53        | —    | 28,685,496.53        |
| 合 计      | <b>75,437,544.40</b> | —    | <b>75,437,544.40</b> | <b>71,183,732.09</b> | —    | <b>71,183,732.09</b> |

(2) 在建工程项目变动情况

| 项 目      | 预算数                   | 期初余额                 | 本期增加金额               | 本期转入固定资产金额       | 本期其他减少金额            | 期末余额                 |
|----------|-----------------------|----------------------|----------------------|------------------|---------------------|----------------------|
| 滨湖商用营业职场 | 120,000,000.00        | 42,498,235.56        | —                    | —                | —                   | 42,498,235.56        |
| 零星工程     | —                     | 28,685,496.53        | 10,632,040.04        | 94,986.67        | 6,283,241.06        | 32,939,308.84        |
| 合 计      | <b>120,000,000.00</b> | <b>71,183,732.09</b> | <b>10,632,040.04</b> | <b>94,986.67</b> | <b>6,283,241.06</b> | <b>75,437,544.40</b> |

(续上表)

| 项 目      | 工程累计投入占预算比例(%) | 利息资本化累计金额 | 其中：本期利息资本化金额 | 本期利息资本化率(%) | 资金来源 |
|----------|----------------|-----------|--------------|-------------|------|
| 滨湖商用营业职场 | 35.42          | —         | —            | —           | 自有资金 |
| 零星工程     | —              | —         | —            | —           | 自有资金 |
| 合 计      |                | —         | —            | —           |      |

注：其他减少 6,283,241.06 元，为转入无形资产金额。

(3) 期末在建工程未发生减值情形，故未计提在建工程减值准备。

## 16、无形资产

### (1) 无形资产情况

| 项 目        | 房屋使用权      | 计算机软件          | 交易席位费         | 其他           | 合计             |
|------------|------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 一、账面原值     |            |                |               |              |                |
| 1.期初余额     | 900,000.00 | 123,412,342.80 | 63,517,978.04 | 2,515,818.32 | 190,346,139.16 |
| 2.本期增加金额   |            | 9,157,838.95   |               |              | 9,157,838.95   |
| (1) 购置     |            | 2,874,597.89   |               |              | 2,874,597.89   |
| (2) 在建工程转入 | —          | 6,283,241.06   | —             | —            | 6,283,241.06   |
| (3) 企业合并增加 | —          | —              | —             | —            | —              |
| 3.本期减少金额   | —          | —              | —             | —            | —              |
| (1) 处置     | —          | —              | —             | —            | —              |

|            |            |                |               |              |                |
|------------|------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 4.外币报表折算差额 |            |                |               | -25,245.68   | -25,245.68     |
| 5.期末余额     | 900,000.00 | 132,570,181.75 | 63,517,978.04 | 2,490,572.64 | 199,478,732.43 |
| 二、累计摊销     |            |                |               |              |                |
| 1.期初余额     | 600,000.00 | 89,379,614.87  | 63,036,950.24 | 44,370.36    | 153,060,935.47 |
| 2.本期增加金额   | 30,000.00  | 8,821,239.00   | 113,107.74    | 7,395.06     | 8,971,741.80   |
| (1) 计提     | 30,000.00  | 8,821,239.00   | 113,107.74    | 7,395.06     | 8,971,741.80   |
| (2) 企业合并增加 | —          | —              | —             | —            | —              |
| 3.本期减少金额   | —          | —              | —             | —            | —              |
| 4.外币报表折算差额 | —          | —              | —             | —            | —              |
| 5.期末余额     | 630,000.00 | 98,200,853.87  | 63,150,057.98 | 51,765.42    | 162,032,677.27 |
| 三、减值准备     |            |                |               |              |                |
| 1.期初余额     | —          | 27,950.00      | —             | —            | 27,950.00      |
| 2.本期增加金额   | —          | —              | —             | —            | —              |
| (1) 计提     | —          | —              | —             | —            | —              |
| (2) 企业合并增加 | —          | —              | —             | —            | —              |
| 3.本期减少金额   | —          | —              | —             | —            | —              |
| 4.外币报表折算差额 | —          | —              | —             | —            | —              |
| 5.期末余额     | —          | 27,950.00      | —             | —            | 27,950.00      |
| 四、账面价值     |            |                |               |              |                |
| 1.期末账面价值   | 270,000.00 | 34,341,377.88  | 367,920.06    | 2,438,807.22 | 37,418,105.16  |
| 2.期初账面价值   | 300,000.00 | 34,004,777.93  | 481,027.80    | 2,471,447.96 | 37,257,253.69  |

(2) 期末无形资产中无抵押、担保或其他所有权受到限制的情况。

## 17、商誉

### (1) 商誉账面原值

| 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                  |
|-----------------|-----------------------|----------|----------|-----------------------|
| 国元期货            | 120,876,333.75        | —        | —        | 120,876,333.75        |
| 股交中心            | 1,830,247.44          | —        | —        | 1,830,247.44          |
| <b>合计</b>       | <b>122,706,581.19</b> | <b>—</b> | <b>—</b> | <b>122,706,581.19</b> |

### (2) 商誉减值准备

| 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     |
|-----------------|----------|----------|----------|----------|
| 国元期货            | —        | —        | —        | —        |
| 股交中心            | —        | —        | —        | —        |
| <b>合 计</b>      | <b>—</b> | <b>—</b> | <b>—</b> | <b>—</b> |

(3) 期末对商誉进行减值测试，商誉没有发生减值的情形，故未计提减值准备。

## 18、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

| 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               |
| 坏账准备           | 17,626,387.22         | 4,406,596.81          | 16,939,362.07         | 4,234,840.52          |
| 固定资产减值准备       | 382,615.47            | 95,653.87             | 382,615.47            | 95,653.87             |
| 无形资产减值准备       | 27,950.00             | 6,987.50              | 27,950.00             | 6,987.50              |
| 已摊销长期股权投资差额    | 10,935,067.16         | 2,733,766.79          | 10,935,067.16         | 2,733,766.79          |
| 可供出售金融资产公允价值变动 |                       |                       | 7,373,563.28          | 1,843,390.82          |
| 可供出售金融资产减值准备   | 32,015,692.02         | 8,003,923.01          | 58,691,180.20         | 14,672,795.05         |
| 交易性金融资产公允价值变动  | 1,095,717.48          | 273,929.38            | 2,258,329.89          | 564,582.49            |
| 期货风险准备金        | 1,143,223.74          | 285,805.94            | 1,143,223.74          | 285,805.94            |
| 未支付职工薪酬        | 257,018,366.92        | 64,254,591.73         | 347,092,190.70        | 86,773,047.68         |
| 买入返售金融资产减值准备   | 69,295,342.27         | 17,323,835.57         | 57,131,248.86         | 14,282,812.22         |
| 融出资金减值准备       | 55,750,772.98         | 13,937,693.25         | 53,427,762.67         | 13,356,940.67         |
| 子公司可抵扣亏损及其他    | 65,524,783.76         | 10,811,589.32         | 131,935,920.12        | 21,769,426.82         |
| <b>合 计</b>     | <b>510,815,919.02</b> | <b>122,134,373.17</b> | <b>687,338,414.16</b> | <b>160,620,050.37</b> |

### (2) 未经抵销的递延所得税负债

| 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        |
| 交易性金融资产公允价值变动  | 7,332,254.97   | 1,833,063.75   | 3,957,053.00   | 989,263.25     |
| 可供出售金融资产公允价值变动 | 826,265,653.95 | 206,566,413.49 | 864,603,402.00 | 216,150,850.50 |



|             |                       |                       |                       |                       |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 被套期项目公允价值变动 | 518,440.64            | 129,610.16            |                       |                       |
| <b>合 计</b>  | <b>834,116,349.56</b> | <b>208,529,087.40</b> | <b>868,560,455.00</b> | <b>217,140,113.75</b> |

## 19、其他资产

### (1) 其他资产按项目列示

| 项 目         | 期末余额                  | 期初余额                  |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| 委托贷款        | 339,200,000.00        | 307,000,000.00        |
| 长期待摊费用      | 29,173,942.15         | 28,992,409.03         |
| 代转承销费用      | 11,810,956.54         | 10,479,747.38         |
| 待摊费用        | 9,033,560.53          | 8,694,685.13          |
| 应收股利        | 7,091,689.81          |                       |
| 被套期项目       | 7,843,920.19          |                       |
| 其他          | 79,087.61             | 209,730.46            |
| <b>账面价值</b> | <b>404,233,156.83</b> | <b>355,376,572.00</b> |

### (2) 委托贷款

| 单 位             | 期末余额                  | 期初余额                  |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 铜陵市顺通物流园有限公司    | 30,000,000.00         | 30,000,000.00         |
| 安徽华力建设集团有限公司    |                       | 16,000,000.00         |
| 合肥超维电子科技有限公司    | 4,200,000.00          | 6,000,000.00          |
| 淮北市交通投资有限公司     | 50,000,000.00         | —                     |
| 安徽蒂王集团酒业有限公司    | 30,000,000.00         | 30,000,000.00         |
| 怀远县城市投资发展有限责任公司 | 50,000,000.00         | 50,000,000.00         |
| 蚌埠河北新区发展有限责任公司  | 35,000,000.00         | 35,000,000.00         |
| 蚌埠村乡好美投资建设有限公司  | 80,000,000.00         | 80,000,000.00         |
| 砀山新区建设投资有限公司    | 50,000,000.00         | 50,000,000.00         |
| 霍山嘉利达小额贷款有限公司   | 10,000,000.00         | 10,000,000.00         |
| <b>合 计</b>      | <b>339,200,000.00</b> | <b>307,000,000.00</b> |

### (3) 长期待摊费用

| 项 目 | 期初余额 | 本期增加 | 本期摊销 | 其他减少 | 期末余额 |
|-----|------|------|------|------|------|
|-----|------|------|------|------|------|

|       |               |              |              |   |               |
|-------|---------------|--------------|--------------|---|---------------|
| 营业部装修 | 28,992,409.03 | 6,105,931.36 | 5,924,398.24 | — | 29,173,942.15 |
|-------|---------------|--------------|--------------|---|---------------|

## 20、资产减值准备

| 项 目          | 期初余额                  | 本期计提                 | 本期减少                |                      | 期末余额                  |
|--------------|-----------------------|----------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|
|              |                       |                      | 转回                  | 转销                   |                       |
| 买入返售金融资产减值准备 | 57,131,248.86         | 12,164,093.41        |                     |                      | 69,295,342.27         |
| 应收账款坏账准备     | 16,939,362.07         | 2,793,730.25         | 2,106,705.10        |                      | 17,626,387.22         |
| 可供出售金融资产减值准备 | 58,691,180.20         | -186,623.37          |                     | 26,488,864.81        | 32,015,692.02         |
| 固定资产减值准备     | 382,615.47            |                      |                     |                      | 382,615.47            |
| 无形资产减值准备     | 27,950.00             |                      |                     |                      | 27,950.00             |
| 融出资金减值准备     | 53,427,762.67         | 2,323,010.31         |                     |                      | 55,750,772.98         |
| <b>合 计</b>   | <b>186,600,119.27</b> | <b>17,094,210.60</b> | <b>2,106,705.10</b> | <b>26,488,864.81</b> | <b>175,098,759.96</b> |

## 21、短期借款

### (1) 短期借款分类

| 项 目        | 期末余额                    | 期初余额                  |
|------------|-------------------------|-----------------------|
| 质押借款       | 611,883,600.00          | 178,900,000.00        |
| 信用借款       | 607,544,000.00          | 796,105,000.00        |
| <b>合 计</b> | <b>1,219,427,600.00</b> | <b>975,005,000.00</b> |

### (2) 短期借款的担保物信息

| 担保物类别    | 期末公允价值           | 期初公允价值           |
|----------|------------------|------------------|
| 股票(香港客户) | 1,688,609,529.44 | 1,414,780,558.00 |

## 22、应付短期融资款

### (1) 应付短期融资款分类

| 项 目   | 期末余额             | 期初余额             |
|-------|------------------|------------------|
| 证券公司债 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |

|            |                         |                         |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 短期融资券      | 2,000,000,000.00        | —                       |
| 次级债        | 3,497,824,257.98        |                         |
| 收益凭证       | 1,118,780,000.00        | 5,136,090,000.00        |
| <b>合 计</b> | <b>9,616,604,257.98</b> | <b>8,136,090,000.00</b> |

## (2) 期末应付短期融资款情况

| 项 目               | 发行日期       | 到期日期       | 票面利率  | 期末余额             | 期初余额             |
|-------------------|------------|------------|-------|------------------|------------------|
| <b>证券公司债：</b>     |            |            |       |                  |                  |
| 16 国元 01          | 2016/8/25  | 2017/8/25  | 3.09% | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| <b>短期融资券：</b>     |            |            |       |                  |                  |
| 17 国元 CP01        | 2017/6/15  | 2017/9/14  | 4.87% | 2,000,000,000.00 | —                |
| <b>次级债：</b>       |            |            |       |                  |                  |
| 15 国元 01          | 2015/5/27  | 2018/5/27  | 5.60% | 3,497,824,257.98 | —                |
| <b>收益凭证：</b>      |            |            |       |                  |                  |
| 元鼎尊享定制 07 期 731 天 | 2015/6/19  | 2017/6/19  | 5.80% | —                | 2,000,000,000.00 |
| 元鼎尊享定制 15 期 520 天 | 2016/7/18  | 2017/12/20 | 3.90% | 500,000,000.00   | 500,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 20 期 91 天  | 2016/11/29 | 2017/2/28  | 3.70% | —                | 500,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 17 期 91 天  | 2016/11/11 | 2017/2/10  | 3.30% | —                | 400,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 19 期 92 天  | 2016/11/22 | 2017/2/22  | 3.48% | —                | 500,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 18 期 181 天 | 2016/11/17 | 2017/5/18  | 3.50% | —                | 550,000,000.00   |
| 元益多 14 天 138 期款项  | 2016/12/20 | 2017/1/3   | 3.00% | —                | 4,590,000.00     |
| 元益多 14 天 139 期款项  | 2016/12/21 | 2017/1/4   | 3.00% | —                | 4,040,000.00     |
| 元益多 14 天 140 期款项  | 2016/12/22 | 2017/1/5   | 3.00% | —                | 3,170,000.00     |
| 元益多 14 天 141 期款项  | 2016/12/27 | 2017/1/10  | 3.10% | —                | 6,070,000.00     |
| 元益多 14 天 142 期款项  | 2016/12/28 | 2017/1/11  | 3.10% | —                | 2,510,000.00     |
| 元益多 14 天 143 期款项  | 2016/12/29 | 2017/1/12  | 3.10% | —                | 3,510,000.00     |
| 元益多 28 天 137 期款项  | 2016/12/7  | 2017/1/4   | 3.10% | —                | 3,330,000.00     |
| 元益多 28 天 138 期款项  | 2016/12/8  | 2017/1/5   | 3.10% | —                | 2,310,000.00     |
| 元益多 28 天 139 期款项  | 2016/12/13 | 2017/1/10  | 3.10% | —                | 3,140,000.00     |
| 元益多 28 天 140 期款项  | 2016/12/14 | 2017/1/11  | 3.10% | —                | 2,680,000.00     |
| 元益多 28 天 141 期款项  | 2016/12/15 | 2017/1/12  | 3.10% | —                | 1,400,000.00     |

|                  |            |           |       |   |              |
|------------------|------------|-----------|-------|---|--------------|
| 元益多 28 天 142 期款项 | 2016/12/20 | 2017/1/17 | 3.20% | — | 100,000.00   |
| 元益多 28 天 143 期款项 | 2016/12/21 | 2017/1/18 | 3.20% | — | 420,000.00   |
| 元益多 28 天 144 期款项 | 2016/12/22 | 2017/1/19 | 3.20% | — | 900,000.00   |
| 元益多 28 天 145 期款项 | 2016/12/27 | 2017/1/24 | 3.30% | — | 1,540,000.00 |
| 元益多 28 天 146 期款项 | 2016/12/28 | 2017/1/25 | 3.30% | — | 550,000.00   |
| 元益多 91 天 120 期款项 | 2016/10/11 | 2017/1/10 | 3.40% | — | 2,590,000.00 |
| 元益多 91 天 121 期款项 | 2016/10/12 | 2017/1/11 | 3.40% | — | 1,330,000.00 |
| 元益多 91 天 122 期款项 | 2016/10/13 | 2017/1/12 | 3.40% | — | 2,640,000.00 |
| 元益多 91 天 123 期款项 | 2016/10/18 | 2017/1/17 | 3.40% | — | 1,500,000.00 |
| 元益多 91 天 124 期款项 | 2016/10/19 | 2017/1/18 | 3.40% | — | 1,530,000.00 |
| 元益多 91 天 125 期款项 | 2016/10/20 | 2017/1/19 | 3.40% | — | 1,430,000.00 |
| 元益多 91 天 126 期款项 | 2016/10/25 | 2017/1/24 | 3.40% | — | 4,000,000.00 |
| 元益多 91 天 127 期款项 | 2016/10/26 | 2017/1/25 | 3.40% | — | 5,100,000.00 |
| 元益多 91 天 128 期款项 | 2016/11/8  | 2017/2/7  | 3.40% | — | 2,340,000.00 |
| 元益多 91 天 129 期款项 | 2016/11/9  | 2017/2/8  | 3.40% | — | 2,170,000.00 |
| 元益多 91 天 130 期款项 | 2016/11/10 | 2017/2/9  | 3.40% | — | 1,330,000.00 |
| 元益多 91 天 131 期款项 | 2016/11/15 | 2017/2/14 | 3.40% | — | 950,000.00   |
| 元益多 91 天 132 期款项 | 2016/11/16 | 2017/2/15 | 3.40% | — | 1,030,000.00 |
| 元益多 91 天 133 期款项 | 2016/11/17 | 2017/2/16 | 3.40% | — | 900,000.00   |
| 元益多 91 天 134 期款项 | 2016/11/22 | 2017/2/21 | 3.40% | — | 970,000.00   |
| 元益多 91 天 135 期款项 | 2016/11/23 | 2017/2/22 | 3.40% | — | 530,000.00   |
| 元益多 91 天 136 期款项 | 2016/11/24 | 2017/2/23 | 3.40% | — | 620,000.00   |
| 元益多 91 天 137 期款项 | 2016/11/29 | 2017/2/28 | 3.40% | — | 1,180,000.00 |
| 元益多 91 天 138 期款项 | 2016/11/30 | 2017/3/1  | 3.40% | — | 1,400,000.00 |
| 元益多 91 天 139 期款项 | 2016/12/1  | 2017/3/2  | 3.40% | — | 1,840,000.00 |
| 元益多 91 天 140 期款项 | 2016/12/6  | 2017/3/7  | 3.40% | — | 860,000.00   |
| 元益多 91 天 141 期款项 | 2016/12/7  | 2017/3/8  | 3.40% | — | 1,320,000.00 |
| 元益多 91 天 142 期款项 | 2016/12/8  | 2017/3/9  | 3.40% | — | 1,890,000.00 |
| 元益多 91 天 143 期款项 | 2016/12/13 | 2017/3/14 | 3.50% | — | 4,210,000.00 |
| 元益多 91 天 144 期款项 | 2016/12/14 | 2017/3/15 | 3.50% | — | 770,000.00   |
| 元益多 91 天 145 期款项 | 2016/12/15 | 2017/3/16 | 3.50% | — | 770,000.00   |

|                      |            |            |       |               |                |
|----------------------|------------|------------|-------|---------------|----------------|
| 元益多 91 天 146 期款项     | 2016/12/20 | 2017/3/21  | 3.60% | —             | 400,000.00     |
| 元益多 91 天 147 期款项     | 2016/12/21 | 2017/3/22  | 3.60% | —             | 1,190,000.00   |
| 元益多 91 天 148 期款项     | 2016/12/22 | 2017/3/23  | 3.60% | —             | 370,000.00     |
| 元益多 91 天大礼包          | 2016/12/22 | 2017/3/23  | 4.50% | —             | 175,290,000.00 |
| 元益多 91 天 149 期款项     | 2016/12/27 | 2017/3/28  | 3.60% | —             | 1,560,000.00   |
| 元益多 91 天 150 期款项     | 2016/12/28 | 2017/3/29  | 3.70% | —             | 570,000.00     |
| 元益多 91 天 151 期款项     | 2016/12/29 | 2017/3/30  | 3.70% | —             | 1,450,000.00   |
| 新客户专享(6.6%)          | 2016/12/21 | 2017/1/4   | 6.60% | —             | 600,000.00     |
| 新客户专享款项(3.7%)        | 2016/12/28 | 2017/1/11  | 3.70% | —             | 500,000.00     |
| 元宝尊享 271 天 2016001 号 | 2016/9/14  | 2017/6/12  | 3.90% | —             | 110,000,000.00 |
| 元宝 182 天 SP0152 号    | 2016/9/14  | 2017/3/15  | 4.20% | —             | 82,200,000.00  |
| 元宝 363 天 2016004 号   | 2016/9/23  | 2017/9/21  | 4.50% | 39,600,000.00 | 39,600,000.00  |
| 元宝 363 天 2016005 号   | 2016/9/23  | 2017/9/21  | 4.80% | 88,400,000.00 | 88,400,000.00  |
| 元宝 363 天 2016006 号   | 2016/12/2  | 2017/11/30 | 4.20% | 78,500,000.00 | 78,500,000.00  |
| 元宝 364 天 2016002 号   | 2016/12/8  | 2017/12/7  | 4.20% | 20,000,000.00 | 20,000,000.00  |
| 元益多 28 天 241 期       | 2017/6/6   | 2017/7/4   | 3.60% | 10,550,000.00 | —              |
| 元益多 14 天 204 期       | 2017/6/20  | 2017/7/4   | 3.50% | 4,970,000.00  | —              |
| 元益多 91 天 188 期       | 2017/4/5   | 2017/7/5   | 4.00% | 2,130,000.00  | —              |
| 元益多 28 天 242 期       | 2017/6/7   | 2017/7/5   | 3.60% | 4,620,000.00  | —              |
| 新客户专享理财 70 期固定       | 2017/6/7   | 2017/7/5   | 6.60% | 4,700,000.00  | —              |
| 元益多 28 天 244 期看涨浮动   | 2017/6/7   | 2017/7/5   | 0.00% | 100,000.00    | —              |
| 元益多 28 天 245 期看跌浮动   | 2017/6/7   | 2017/7/5   | 0.00% | 200,000.00    | —              |
| 元益多 14 天 205 期       | 2017/6/21  | 2017/7/5   | 3.50% | 2,040,000.00  | —              |
| 元益多 91 天 189 期       | 2017/4/6   | 2017/7/6   | 4.00% | 2,870,000.00  | —              |
| 元益多 28 天 243 期       | 2017/6/8   | 2017/7/6   | 3.60% | 1,500,000.00  | —              |
| 元益多 14 天 206 期       | 2017/6/22  | 2017/7/6   | 3.50% | 4,210,000.00  | —              |
| 元益多 91 天 190 期       | 2017/4/11  | 2017/7/11  | 4.00% | 2,840,000.00  | —              |
| 元益多 28 天 246 期       | 2017/6/13  | 2017/7/11  | 3.70% | 3,760,000.00  | —              |
| 元益多 14 天 207 期       | 2017/6/27  | 2017/7/11  | 3.50% | 2,520,000.00  | —              |
| 元益多 91 天 191 期       | 2017/4/12  | 2017/7/12  | 4.00% | 7,880,000.00  | —              |
| 元益多 28 天 247 期       | 2017/6/14  | 2017/7/12  | 3.70% | 10,970,000.00 | —              |

|                    |           |           |       |               |   |
|--------------------|-----------|-----------|-------|---------------|---|
| 新客户专享理财 71 期固定     | 2017/6/14 | 2017/7/12 | 6.60% | 3,900,000.00  | — |
| 元益多 28 天 249 期看涨浮动 | 2017/6/14 | 2017/7/12 | 0.00% | 150,000.00    | — |
| 元益多 14 天 208 期     | 2017/6/28 | 2017/7/12 | 3.50% | 1,520,000.00  | — |
| 元益多 91 天 192 期     | 2017/4/13 | 2017/7/13 | 4.00% | 12,530,000.00 | — |
| 元益多 28 天 248 期     | 2017/6/15 | 2017/7/13 | 3.70% | 7,440,000.00  | — |
| 元益多 14 天 209 期     | 2017/6/29 | 2017/7/13 | 3.50% | 2,300,000.00  | — |
| 元益多 91 天 193 期     | 2017/4/18 | 2017/7/18 | 4.00% | 9,610,000.00  | — |
| 元益多 28 天 251 期     | 2017/6/20 | 2017/7/18 | 3.70% | 4,720,000.00  | — |
| 元益多 91 天 194 期     | 2017/4/19 | 2017/7/19 | 4.00% | 3,670,000.00  | — |
| 元益多 28 天 252 期     | 2017/6/21 | 2017/7/19 | 3.70% | 2,460,000.00  | — |
| 新客户专享理财 72 期固定     | 2017/6/21 | 2017/7/19 | 6.60% | 3,950,000.00  | — |
| 元益多 28 天 254 期看涨浮动 | 2017/6/21 | 2017/7/19 | 0.00% | 100,000.00    | — |
| 元益多 91 天 195 期     | 2017/4/20 | 2017/7/20 | 4.00% | 590,000.00    | — |
| 元益多 28 天 253 期     | 2017/6/22 | 2017/7/20 | 3.70% | 1,960,000.00  | — |
| 元益多 91 天 196 期     | 2017/4/25 | 2017/7/25 | 3.90% | 1,800,000.00  | — |
| 元益多 28 天 256 期     | 2017/6/27 | 2017/7/25 | 3.70% | 1,630,000.00  | — |
| 元益多 91 天 197 期     | 2017/4/26 | 2017/7/26 | 3.90% | 1,950,000.00  | — |
| 元益多 28 天 257 期     | 2017/6/28 | 2017/7/26 | 3.70% | 970,000.00    | — |
| 新客户专享理财 73 期固定     | 2017/6/28 | 2017/7/26 | 6.60% | 3,000,000.00  | — |
| 相鑫 3 号 (营业部)       | 2017/6/28 | 2017/7/26 | 6.80% | 600,000.00    | — |
| 元益多 28 天 259 期看涨浮动 | 2017/6/28 | 2017/7/26 | 0.00% | 50,000.00     | — |
| 元益多 28 天 260 期看跌浮动 | 2017/6/28 | 2017/7/26 | 0.00% | 700,000.00    | — |
| 元益多 91 天 198 期     | 2017/4/27 | 2017/7/27 | 3.90% | 780,000.00    | — |
| 元益多 28 天 258 期     | 2017/6/29 | 2017/7/27 | 3.70% | 1,930,000.00  | — |
| 元益多 91 天 199 期     | 2017/5/2  | 2017/8/1  | 3.90% | 50,000.00     | — |
| 元益多 91 天 200 期     | 2017/5/3  | 2017/8/2  | 3.90% | 700,000.00    | — |
| 元益多 91 天 201 期     | 2017/5/4  | 2017/8/3  | 3.90% | 270,000.00    | — |
| 元益多 91 天 202 期     | 2017/5/9  | 2017/8/8  | 3.90% | 330,000.00    | — |
| 元益多 91 天 203 期     | 2017/5/10 | 2017/8/9  | 3.90% | 380,000.00    | — |
| 元益多 91 天 204 期     | 2017/5/11 | 2017/8/10 | 3.90% | 1,290,000.00  | — |
| 元益多 91 天 205 期     | 2017/5/16 | 2017/8/15 | 4.00% | 860,000.00    | — |

|                        |           |            |       |                         |                         |
|------------------------|-----------|------------|-------|-------------------------|-------------------------|
| 元益多 91 天 206 期         | 2017/5/17 | 2017/8/16  | 4.00% | 430,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 207 期         | 2017/5/18 | 2017/8/17  | 4.00% | 310,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 208 期         | 2017/5/23 | 2017/8/22  | 4.00% | 750,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 209 期         | 2017/5/24 | 2017/8/23  | 4.00% | 800,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 210 期         | 2017/5/25 | 2017/8/24  | 4.00% | 1,060,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 211 期         | 2017/5/31 | 2017/8/30  | 4.00% | 760,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 212 期         | 2017/6/1  | 2017/8/31  | 4.00% | 320,000.00              | —                       |
| 元益多 91 天 213 期         | 2017/6/6  | 2017/9/5   | 4.10% | 12,450,000.00           | —                       |
| 元益多 91 天 214 期         | 2017/6/7  | 2017/9/6   | 4.10% | 3,590,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 215 期         | 2017/6/8  | 2017/9/7   | 4.10% | 1,220,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 216 期         | 2017/6/13 | 2017/9/12  | 4.50% | 14,650,000.00           | —                       |
| 元益多 91 天 217 期         | 2017/6/14 | 2017/9/13  | 4.50% | 4,920,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 218 期         | 2017/6/15 | 2017/9/14  | 4.50% | 4,290,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 219 期         | 2017/6/20 | 2017/9/19  | 4.50% | 8,020,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 220 期         | 2017/6/21 | 2017/9/20  | 4.50% | 2,260,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 221 期         | 2017/6/22 | 2017/9/21  | 4.50% | 4,000,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 222 期         | 2017/6/27 | 2017/9/26  | 4.50% | 4,240,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 223 期         | 2017/6/28 | 2017/9/27  | 4.50% | 1,260,000.00            | —                       |
| 元益多 91 天 224 期         | 2017/6/29 | 2017/9/28  | 4.50% | 4,570,000.00            | —                       |
| 元鼎尊享定制 38 期            | 2017/5/10 | 2017/11/13 | 4.60% | 70,000,000.00           | —                       |
| 元益多 182 天 01 期(端午节大礼包) | 2017/5/17 | 2017/11/15 | 4.60% | 49,220,000.00           | —                       |
| 元益多 182 天 02 期(端午节大礼包) | 2017/5/24 | 2017/11/22 | 4.60% | 35,110,000.00           | —                       |
| 元鼎尊享定制 37 期            | 2017/4/17 | 2018/1/17  | 4.05% | 30,000,000.00           | —                       |
| <b>合 计</b>             |           |            |       | <b>9,616,604,257.98</b> | <b>8,136,090,000.00</b> |

### 23、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

| 项 目             | 期末余额              | 期初余额             |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 第三方在结构化主体中享有的权益 | 11,372,270,008.52 | 9,896,296,729.50 |

本公司将具有控制权的结构化主体（主要为资产管理计划）纳入合并财务报表的合并范围，将本公司以外第三方持有的结构化主体份额确认为交易性金融负债。

### 24、卖出回购金融资产款

(1) 按金融资产种类列示

| 项 目          | 期末余额                    | 期初余额                    |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| 债 券          | 4,487,430,227.50        | 2,875,290,080.00        |
| 融资融券债权收益权    | 1,500,000,000.00        | 1,410,000,000.00        |
| 交易所股票质押债权收益权 |                         | —                       |
| <b>合 计</b>   | <b>5,987,430,227.50</b> | <b>4,285,290,080.00</b> |

(2) 按业务类别列示

| 项 目        | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 债券质押式报价回购  | 42,837,000.00           | 245,312,000.00          |
| 交易所质押式回购   | 4,444,593,227.50        | 2,629,978,080.00        |
| 融资融券债权收益权  | 1,500,000,000.00        | 1,410,000,000.00        |
| <b>合 计</b> | <b>5,987,430,227.50</b> | <b>4,285,290,080.00</b> |

(3) 卖出回购金融资产的剩余期限和利率区间

| 项 目        | 期末余额                    | 利率区间        | 期初余额                    | 利率区间         |
|------------|-------------------------|-------------|-------------------------|--------------|
| 1个月以内      | 4,481,351,229.00        | 1.50%-6.50% | 2,863,622,080.00        | 0.54%-15.60% |
| 1-3个月      | 6,078,998.50            |             | 11,668,000.00           |              |
| 3个月-1年     | -                       |             | 910,000,000.00          |              |
| 1年以上       | 1,500,000,000.00        |             | 500,000,000.00          |              |
| <b>合 计</b> | <b>5,987,430,227.50</b> |             | <b>4,285,290,080.00</b> |              |

(4) 卖出回购金融资产款的担保物信息

| 担保物类别      | 期末公允价值                   | 期初公允价值                  |
|------------|--------------------------|-------------------------|
| 债 券        | 9,024,649,865.84         | 5,391,576,604.49        |
| 融资融券债权     | 1,731,131,610.65         | 1,735,821,244.55        |
| 交易所股票质押债权  |                          | —                       |
| <b>合 计</b> | <b>10,755,781,476.49</b> | <b>7,127,397,849.04</b> |

(5) 卖出回购金融资产款期末余额较期初增长 39.72%，主要为正回购融入资金规模增加所致。

25、代理买卖证券款



| 项 目    | 期末余额                     | 期初余额                     |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 普通经纪业务 |                          |                          |
| 个人     | 11,171,245,213.82        | 12,207,421,341.19        |
| 机构     | 990,180,401.70           | 881,926,743.28           |
| 小 计    | <b>12,161,425,615.52</b> | <b>13,089,348,084.47</b> |
| 信用业务   |                          |                          |
| 个人     | 1,811,051,663.65         | 2,723,878,885.82         |
| 机构     | 1,526,059,388.51         | 682,583,748.48           |
| 小 计    | <b>3,337,111,052.16</b>  | <b>3,406,462,634.30</b>  |
| 合 计    | <b>15,498,536,667.68</b> | <b>16,495,810,718.77</b> |

## 26、应付职工薪酬

### (1) 应付职工薪酬列示

| 项 目          | 期初余额                  | 本期增加                  | 本期减少                  | 期末余额                  |
|--------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 短期薪酬         | 397,872,006.73        | 619,184,493.05        | 712,001,439.65        | 305,055,060.13        |
| 离职后福利-设定提存计划 | 597,262.49            | 32,383,085.89         | 32,125,563.00         | 854,785.38            |
| 合 计          | <b>398,469,269.22</b> | <b>651,567,578.94</b> | <b>744,127,002.65</b> | <b>305,909,845.51</b> |

### (2) 短期薪酬列示

| 项 目         | 期初余额                  | 本期增加                  | 本期减少                  | 期末余额                  |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 372,055,107.47        | 570,604,969.11        | 662,388,148.72        | 280,271,927.86        |
| 职工福利费       | —                     | 16,848,911.04         | 16,848,911.04         | -                     |
| 社会保险费       | 249,893.34            | 9,857,408.75          | 9,734,006.44          | 373,295.65            |
| 其中：医疗保险费    | 238,504.72            | 8,783,674.92          | 8,676,528.25          | 345,651.39            |
| 工伤保险费       | 5,223.03              | 238,276.43            | 234,323.24            | 9,176.22              |
| 生育保险费       | 6,165.59              | 835,457.40            | 823,154.95            | 18,468.04             |
| 住房公积金       | 269,705.71            | 13,407,616.52         | 12,256,097.08         | 1,421,225.15          |
| 工会经费和职工教育经费 | 25,297,300.21         | 8,465,587.63          | 10,774,276.37         | 22,988,611.47         |
| 合 计         | <b>397,872,006.73</b> | <b>619,184,493.05</b> | <b>712,001,439.65</b> | <b>305,055,060.13</b> |

### (3) 设定提存计划列示

| 项 目        | 期初余额              | 本期增加                 | 本期减少                 | 期末余额              |
|------------|-------------------|----------------------|----------------------|-------------------|
| 基本养老保险     | 475,972.73        | 21,481,908.82        | 21,219,484.24        | 738,397.31        |
| 失业保险费      | 119,399.76        | 922,184.07           | 925,341.76           | 116,242.07        |
| 企业年金缴费     | 1,890.00          | 9,978,993.00         | 9,980,737.00         | 146.00            |
| <b>合 计</b> | <b>597,262.49</b> | <b>32,383,085.89</b> | <b>32,125,563.00</b> | <b>854,785.38</b> |

(4) 期末应付工资、奖金、津贴和补贴中无属于拖欠性质的部分。

(5) 本期实际发放的高级管理人员薪酬为：1,605.07 万元。高级管理人员参照《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》（证监会令第 39 号）界定范围执行，不含境内分支机构负责人。

## 27、应交税费

| 项 目           | 期末余额                 | 期初余额                  |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 企业所得税         | 56,853,168.90        | 182,573,571.08        |
| 个人所得税         | 5,247,892.44         | 17,689,920.74         |
| 投资者保护基金       | 10,169,921.62        | 13,187,592.56         |
| 城建税           | 849,388.06           | 1,024,306.63          |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 604,777.01           | 733,750.09            |
| 增值税           | 19,717,953.00        | 21,604,186.75         |
| 其他税费          | 2,474,024.72         | 2,703,416.91          |
| <b>合 计</b>    | <b>95,917,125.75</b> | <b>239,516,744.76</b> |

应交税费期末余额较期初下降 59.95%，主要系本报告期缴纳 2016 年度汇算清缴所得税所致。

## 28、应付款项

(1) 按类别列示

| 项 目         | 期末余额           | 期初余额          |
|-------------|----------------|---------------|
| 应付证券清算款     | 209,066,836.30 | 39,631,062.92 |
| 安徽省安通发展有限公司 | 3,279,701.73   | 3,279,701.73  |
| 暂收款         | 231,537,471.28 | 47,366,684.49 |
| 预收款         | 9,741,114.30   | 11,531,362.00 |

|            |                       |                       |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 预留风险金      | 14,320,651.58         | 16,266,503.11         |
| 其他         | 60,101,807.68         | 51,610,572.03         |
| <b>合 计</b> | <b>528,047,582.87</b> | <b>169,685,886.28</b> |

(2) 账龄超过 1 年的重要应付款项

| 单位名称        | 期末余额         | 未偿还或结转的原因 |
|-------------|--------------|-----------|
| 安徽省安通发展有限公司 | 3,279,701.73 | 未支付的债券兑付款 |

(3) 应付款项期末余额较期初增长 211.19%，主要系暂收待清算款增加所致。

## 29、应付利息

| 项 目        | 期末余额                  | 期初余额                  |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 客户资金       | 304,626.03            | 538,445.48            |
| 应付债券       | 325,197,918.09        | 254,132,672.19        |
| 应付收益凭证     | 41,773,537.36         | 201,239,757.13        |
| 卖出回购证券款    | 3,391,580.91          | 6,153,809.94          |
| 报价式回购利息    | 22,036.26             | 52,061.96             |
| <b>合 计</b> | <b>370,689,698.65</b> | <b>462,116,746.70</b> |

## 30、预计负债

| 项 目  | 期末余额         | 期初余额         | 形成原因 |
|------|--------------|--------------|------|
| 未决诉讼 | 5,592,088.55 | 5,592,088.55 |      |

预计负债未决诉讼的具体情况见本附注“十一、或有事项”。

## 31、应付债券

### (1) 应付债券

| 项 目        | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 证券公司债      | 4,997,186,506.05        | 4,995,726,135.47        |
| 次级债        | —                       | 3,496,535,460.67        |
| 收益凭证       | 2,020,000,000.00        | 1,000,000,000.00        |
| <b>合 计</b> | <b>7,017,186,506.05</b> | <b>9,492,261,596.14</b> |

### (2) 证券公司债

| 债券类型     | 面值                      | 发行日期      | 到期日期      | 债券期限  | 票面利率  | 发行金额                    |
|----------|-------------------------|-----------|-----------|-------|-------|-------------------------|
| 证券公司债：   |                         |           |           |       |       |                         |
| 13 国元 01 | 3,270,000,000.00        | 2013/7/24 | 2018/7/24 | 3+2 年 | 4.70% | 3,270,000,000.00        |
| 13 国元 02 | 1,730,000,000.00        | 2013/7/24 | 2018/7/24 | 5 年   | 4.90% | 1,730,000,000.00        |
| 合 计      | <b>5,000,000,000.00</b> |           |           |       |       | <b>5,000,000,000.00</b> |

(续上表)

| 债券类型     | 期初账面余额                  | 本期增加 | 利息调整                | 本期减少 | 期末账面余额                  |
|----------|-------------------------|------|---------------------|------|-------------------------|
| 证券公司债：   |                         |      |                     |      |                         |
| 13 国元 01 | 3,270,000,000.00        | —    | —                   | —    | 3,270,000,000.00        |
| 13 国元 02 | 1,725,726,135.47        | —    | 1,460,370.58        | —    | 1,727,186,506.05        |
| 合 计      | <b>4,995,726,135.47</b> | —    | <b>1,460,370.58</b> | —    | <b>4,997,186,506.05</b> |

注：公司债券 13 国元 01 为 5 年期，附第 3 年末公司上调票面利率选择权及投资者回售选择权，在债券发行的第三年末即 2016 年 7 月 24 日投资者有向本公司回售该债券的权利，2016 年 7 月 24 日投资者未实行相关权利，本次列示该债券期限为 3+2 年，到期日为 2018 年 7 月 24 日。

### (3) 次级债

| 次级债      | 面值               | 发行日期      | 到期日期      | 债券期限 | 票面利率  | 发行金额             |
|----------|------------------|-----------|-----------|------|-------|------------------|
| 15 国元 01 | 3,500,000,000.00 | 2015/5/27 | 2018/5/27 | 3 年  | 5.60% | 3,500,000,000.00 |

(续上表)

| 次级债      | 期初账面余额           | 本期增加 | 利息调整 | 本期减少             | 期末账面余额 |
|----------|------------------|------|------|------------------|--------|
| 15 国元 01 | 3,496,535,460.67 | —    | —    | 3,496,535,460.67 | —      |

### (4) 收益凭证

| 债券类型              | 面值             | 发行日期       | 到期日期      | 债券期限  | 票面利率  | 发行金额           |
|-------------------|----------------|------------|-----------|-------|-------|----------------|
| 收益凭证              |                |            |           |       |       |                |
| 元鼎尊享定制 21 期 427 天 | 100,000,000.00 | 2016/12/12 | 2018/2/12 | 427 天 | 3.30% | 100,000,000.00 |
| 元鼎尊享定制 22 期 427 天 | 100,000,000.00 | 2016/12/12 | 2018/2/12 | 427 天 | 3.30% | 100,000,000.00 |
| 元鼎尊享定制 23 期 455 天 | 100,000,000.00 | 2016/12/12 | 2018/3/12 | 455 天 | 3.40% | 100,000,000.00 |

|                   |                         |            |            |       |       |                         |
|-------------------|-------------------------|------------|------------|-------|-------|-------------------------|
| 元鼎尊享定制 24 期 455 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/3/12  | 455 天 | 3.40% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 25 期 455 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/3/12  | 455 天 | 3.40% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 26 期 455 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/3/12  | 455 天 | 3.40% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 27 期 547 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/6/12  | 547 天 | 3.50% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 28 期 547 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/6/12  | 547 天 | 3.50% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 29 期 547 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/6/12  | 547 天 | 3.50% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 30 期 547 天 | 100,000,000.00          | 2016/12/12 | 2018/6/12  | 547 天 | 3.50% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 31 期 546 天 | 100,000,000.00          | 2017/2/14  | 2018/8/14  | 546 天 | 3.85% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 32 期 546 天 | 100,000,000.00          | 2017/2/14  | 2018/8/14  | 546 天 | 3.85% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 33 期 549 天 | 100,000,000.00          | 2017/3/14  | 2018/9/14  | 549 天 | 3.90% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 34 期 549 天 | 100,000,000.00          | 2017/3/14  | 2018/9/14  | 549 天 | 3.90% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 35 期 549 天 | 100,000,000.00          | 2017/3/14  | 2018/9/14  | 549 天 | 3.90% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 36 期 549 天 | 100,000,000.00          | 2017/3/14  | 2018/9/14  | 549 天 | 3.90% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 39 期 637 天 | 1,000,000,000.00        | 2017/5/17  | 2019/2/13  | 637 天 | 5.20% | 1,000,000,000.00        |
| 元鼎尊享定制 40 期 395 天 | 200,000,000.00          | 2017/6/13  | 2018/7/13  | 395 天 | 4.20% | 200,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 41 期 548 天 | 100,000,000.00          | 2017/6/13  | 2018/12/13 | 548 天 | 4.60% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 42 期 548 天 | 100,000,000.00          | 2017/6/13  | 2018/12/13 | 548 天 | 4.60% | 100,000,000.00          |
| 元鼎尊享定制 43 期 456 天 | 20,000,000.00           | 2017/6/27  | 2018/9/26  | 456 天 | 4.50% | 20,000,000.00           |
| <b>合 计</b>        | <b>3,020,000,000.00</b> |            |            |       |       | <b>3,020,000,000.00</b> |

(续上表)

| 债券类型 | 期初账面余额 | 本期增加 | 利息调整 | 本期减少 | 期末账面余额 |
|------|--------|------|------|------|--------|
| 收益凭证 |        |      |      |      |        |

|                   |                  |                  |   |                  |                  |
|-------------------|------------------|------------------|---|------------------|------------------|
| 元鼎尊享定制 21 期 427 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 22 期 427 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 23 期 455 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 24 期 455 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 25 期 455 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 26 期 455 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 27 期 547 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 28 期 547 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 29 期 547 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 30 期 547 天 | 100,000,000.00   | —                | — | 100,000,000.00   | —                |
| 元鼎尊享定制 31 期 546 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 32 期 546 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 33 期 549 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 34 期 549 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 35 期 549 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 36 期 549 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 39 期 637 天 | —                | 1,000,000,000.00 | — | —                | 1,000,000,000.00 |
| 元鼎尊享定制 40 期 395 天 | —                | 200,000,000.00   | — | —                | 200,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 41 期 548 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 42 期 548 天 | —                | 100,000,000.00   | — | —                | 100,000,000.00   |
| 元鼎尊享定制 43 期 456 天 | —                | 20,000,000.00    | — | —                | 20,000,000.00    |
| 合 计               | 1,000,000,000.00 | 2,020,000,000.00 | — | 1,000,000,000.00 | 2,020,000,000.00 |

### 32、其他负债

| 项 目     | 期末余额                 | 期初余额                 |
|---------|----------------------|----------------------|
| 预提费用    | 19,529,791.46        | 11,853,544.94        |
| 期货风险准备金 | 19,515,437.68        | 18,138,825.96        |
| 代理兑付债券款 | 279,219.66           | 279,219.66           |
| 其他      | 1,160,686.00         | 479.38               |
| 合 计     | <b>40,485,134.80</b> | <b>30,272,069.94</b> |

其他负债期末余额较期初增长 33.74%，主要系预提费用增加所致。

### 33、股本

| 项 目           | 期初余额(万元)          | 本期变动增 (+) 减 (-) |    |                  |    |                  | 期末余额 (万元)         |
|---------------|-------------------|-----------------|----|------------------|----|------------------|-------------------|
|               |                   | 发行新股            | 送股 | 公积金转股            | 其他 | 小计               |                   |
| 1. 有限售条件股份    |                   |                 |    |                  |    |                  |                   |
| (1). 国家持股     | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| (2). 国有法人持股   | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| (3). 其他内资持股   | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| 其中:           |                   |                 |    |                  |    |                  |                   |
| 境内法人持股        | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| 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       | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| 有限售条件股份合计     | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| 2. 无限售条件流通股   |                   |                 |    |                  |    |                  |                   |
| (1). 人民币普通股   | 196,410.00        |                 |    | 98,205.00        |    | 98,205.00        | 294,615.00        |
| (2). 境内上市的外资股 | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| (3). 境外上市的外资股 | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| (4). 其他       | —                 | —               | —  | —                | —  | —                | —                 |
| 无限售条件流通股合计    | 196,410.00        |                 |    | 98,205.00        |    | 98,205.00        | 294,615.00        |
| <b>合 计</b>    | <b>196,410.00</b> |                 |    | <b>98,205.00</b> |    | <b>98,205.00</b> | <b>294,615.00</b> |

股本本报告期增加 98,205.00 万元，主要系本报告期实施 2016 年度利润分配方案转增股票所致。

### 34、资本公积

| 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） | 9,835,082,591.38 | —    | 982,050,000.00 | 8,853,032,591.38 |
| 其他资本公积     | —                | —    | —              | —                |

|     |                  |   |                |                  |
|-----|------------------|---|----------------|------------------|
| 合 计 | 9,835,082,591.38 | — | 982,050,000.00 | 8,853,032,591.38 |
|-----|------------------|---|----------------|------------------|

资本公积股本溢价本期减少 982,050,000.00 元，主要系实施 2016 年度利润分配所致：公司以 2016 年 12 月 31 日总股本 1,964,100,000 股为基础，以资本公积（股本溢价）向全体股东每 10 股转增 5 股，共计转增股本 982,050,000 股。

### 35、其他综合收益

| 项 目                                 | 期初余额                  | 本期发生金额                |                      |                       |                       |                  | 期末余额                  |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------------------|
|                                     |                       | 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                   | —                     | —                     | —                    | —                     | —                     | —                | —                     |
| 以后将重分类进损益的其他综合收益                    | 710,980,050.56        | -21,146,917.57        | 75,026,941.54        | -18,756,735.39        | -77,466,917.84        | 49,794.12        | 633,513,132.72        |
| 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 | 10,044,588.88         | 4,094,306.40          |                      |                       | 4,094,306.40          |                  | 14,138,895.28         |
| 可供出售金融资产公允价值变动损益                    | 642,894,721.69        | 11,666,726.06         | 75,026,941.54        | -18,756,735.39        | -44,653,274.21        | 49,794.12        | 598,241,447.48        |
| 外币财务报表折算差额                          | 57,868,739.99         | -36,907,950.03        |                      |                       | -36,907,950.03        |                  | 20,960,789.96         |
| 其他                                  | 172,000.00            |                       |                      |                       | 0.00                  |                  | 172,000.00            |
| <b>其他综合收益合计</b>                     | <b>710,980,050.56</b> | <b>-21,146,917.57</b> | <b>75,026,941.54</b> | <b>-18,756,735.39</b> | <b>-77,466,917.84</b> | <b>49,794.12</b> | <b>633,513,132.72</b> |

### 36、盈余公积

| 项 目    | 期初余额             | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额             |
|--------|------------------|------|------|------------------|
| 法定盈余公积 | 1,178,846,019.19 | —    | —    | 1,178,846,019.19 |

### 37、一般风险准备

| 项 目        | 期初余额                    | 本期增加     | 本期减少     | 期末余额                    |
|------------|-------------------------|----------|----------|-------------------------|
| 一般风险准备     | 1,243,620,090.78        | —        | —        | 1,243,620,090.78        |
| 交易风险准备     | 1,132,814,569.68        | —        | —        | 1,132,814,569.68        |
| <b>合 计</b> | <b>2,376,434,660.46</b> | <b>—</b> | <b>—</b> | <b>2,376,434,660.46</b> |

### 38、未分配利润

| 项 目     | 本期发生额            | 上期发生额            | 提取比例 |
|---------|------------------|------------------|------|
| 年初未分配利润 | 4,676,622,766.89 | 4,454,244,552.95 |      |



|                |                         |                         |     |
|----------------|-------------------------|-------------------------|-----|
| 加：会计政策变更       |                         |                         |     |
| 加：本期净利润        | 513,718,293.29          | 510,562,083.71          |     |
| 减：提取法定盈余公积     |                         |                         | 10% |
| 提取一般风险准备       |                         |                         | 10% |
| 提取交易风险准备       |                         |                         | 10% |
| 应付普通股股利        | 589,230,000.00          | 483,634,629.00          |     |
| <b>期末未分配利润</b> | <b>4,601,111,060.18</b> | <b>4,481,172,007.66</b> |     |

### 39、少数股东权益

| 少数股东单位           | 期末余额                  | 期初余额                  |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 康和期货股份有限公司       | 10,708,081.58         | 10,489,333.32         |
| 安徽国元控股（集团）有限责任公司 | 41,071,981.21         | 43,160,829.27         |
| 华安证券股份有限公司       | 36,832,485.71         | 38,691,140.19         |
| 安徽省产权交易中心有限责任公司  | 14,732,994.28         | 15,476,456.08         |
| 合肥兴泰控股集团有限公司     | 12,277,495.23         | 12,897,046.73         |
| 芜湖市建设投资有限公司      | 12,277,495.23         | 12,897,046.73         |
| 蚌埠市产权交易中心        | 6,138,747.62          | 6,448,523.37          |
| 安徽省粮油食品进出口集团公司   | 216,318.25            | 233,556.97            |
| 淮北市国有资产运营有限公司    | 3,194,036.36          | 3,135,546.93          |
| <b>合 计</b>       | <b>137,449,635.47</b> | <b>143,429,479.59</b> |

### 40、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入按类别列示

| 项 目             | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>手续费及佣金收入</b> | <b>750,317,652.01</b> | <b>843,950,071.73</b> |
| 1.经纪业务收入        | 515,161,645.07        | 614,927,433.61        |
| 其中：证券经纪业务收入     | 487,551,953.01        | 592,827,222.79        |
| 其中：代理买卖证券业务     | 484,536,615.23        | 584,691,304.94        |
| 交易单元席位租赁        | 2,028,540.97          | 4,654,343.59          |
| 代销金融产品业务        | 986,796.76            | 3,481,574.26          |

|                  |                       |                       |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 期货经纪业务收入         | 27,609,692.06         | 22,100,210.82         |
| 2.投资银行业务收入       | 193,105,411.59        | 183,397,109.73        |
| 其中：证券承销业务        | 145,959,351.43        | 125,112,879.40        |
| 证券保荐业务           | 6,809,222.77          | 12,461,974.18         |
| 财务顾问业务           | 40,336,837.39         | 45,822,256.15         |
| 3.投资咨询业务收入       | 2,610,411.32          | 5,959,844.80          |
| 4.资产管理业务收入       | 30,172,358.15         | 33,052,669.63         |
| 5.其他             | 9,267,825.88          | 6,613,013.96          |
| <b>手续费及佣金支出</b>  | <b>162,975,507.61</b> | <b>120,739,866.54</b> |
| 1.经纪业务支出         | 154,197,323.99        | 103,309,358.40        |
| 其中：证券经纪业务支出      | 152,666,250.78        | 101,543,334.62        |
| 其中：代理买卖证券业务      | 152,663,975.78        | 101,528,324.70        |
| 交易单元席位租赁         | -                     |                       |
| 代销金融产品业务         | -                     | 210.92                |
| 期货经纪业务支出         | 1,531,073.21          | 1,766,023.78          |
| 2.投资银行业务支出       | 8,750,623.94          | 4,302,042.77          |
| 其中：证券承销业务        | 8,750,623.94          | 4,302,042.77          |
| 证券保荐业务           | —                     |                       |
| 财务顾问业务           | —                     |                       |
| 3.投资咨询业务支出       | —                     |                       |
| 4.资产管理业务支出       | 27,230.10             | 13,128,465.34         |
| 5.其他             | 329.58                | 0.03                  |
| <b>手续费及佣金净收入</b> | <b>587,342,144.40</b> | <b>723,210,205.19</b> |
| 其中：财务顾问业务净收入     | 40,336,837.39         | 45,822,256.15         |
| —并购重组财务顾问业务净收入   |                       |                       |
| ——境内上市公司         | 13,867,924.53         | 5,000,000.00          |
| ——并购重组财务顾问业务净收入  |                       |                       |
| ——其他             | —                     |                       |

|              |               |               |
|--------------|---------------|---------------|
| —其他财务顾问业务净收入 | 26,468,912.86 | 40,822,256.15 |
|--------------|---------------|---------------|

(2) 按地理区域列示的营业部家数及经纪业务净收入情况

| 区 域        | 本期         |                       | 上期        |                       |
|------------|------------|-----------------------|-----------|-----------------------|
|            | 营业部家数      | 手续费净收入                | 营业部家数     | 手续费净收入                |
| 安徽地区       | 53         | 164,355,620.51        | 43        | 258,413,987.37        |
| 上海、江苏、浙江地区 | 27         | 46,992,297.33         | 19        | 68,601,788.77         |
| 广东地区       | 13         | 34,806,838.32         | 9         | 52,031,788.35         |
| 北京、天津地区*注  | 5          | 41,039,003.43         | 4         | 39,516,139.68         |
| 山东地区       | 8          | 23,021,520.01         | 6         | 35,086,120.24         |
| 辽宁地区       | 4          | 8,095,208.56          | 4         | 13,400,802.02         |
| 重庆地区       | 1          | 6,237,962.99          | 1         | 7,209,252.91          |
| 福建地区       | 2          | 2,453,533.27          | 2         | 4,441,592.02          |
| 湖南地区       | 1          | 887,335.93            | 1         | 1,308,192.59          |
| 河南地区       | 4          | 2,965,433.54          | 2         | 3,792,996.47          |
| 湖北地区       | 2          | 2,562,671.18          | 1         | 4,491,824.18          |
| 山西地区       | 1          | 3,131,013.00          | 1         | 1,906,521.28          |
| 贵州地区       | 2          | 664,778.49            | 1         | 1,248,985.84          |
| 江西地区       | 1          | 807,826.58            | 1         | 890,254.17            |
| 陕西地区       | 2          | 2,267,267.12          | 1         | 3,359,998.55          |
| 四川地区       | 1          | 357,352.82            | 1         | 432,521.39            |
| 香港地区       | 1          | 20,318,658.00         | 1         | 15,485,309.38         |
| <b>合 计</b> | <b>128</b> | <b>360,964,321.08</b> | <b>98</b> | <b>511,618,075.21</b> |

\*注：包括国元期货有限公司

(3) 代理销售金融产品业务收入情况

| 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      | 1,228,630,795.11 | 976,268.60 | 3,618,959,687.66 | 3,460,129.20 |

|            |                          |                   |                          |                     |
|------------|--------------------------|-------------------|--------------------------|---------------------|
| 资产管理业务产品   | 50,439,710,704.89        | 10,528.16         | 39,530,842,306.99        | 21,445.06           |
| <b>合 计</b> | <b>51,668,341,500.00</b> | <b>986,796.76</b> | <b>43,149,801,994.65</b> | <b>3,481,574.26</b> |

## (4) 资产管理业务收入情况

**2017 年度 1-6 月**

| 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       | 23                | 88                 | 1                |
| 期末客户数量       | 20,825            | 88                 | 6                |
| 其中：个人客户      | 20,708            | 9                  |                  |
| 机构客户         | 117               | 79                 | 6                |
| 年初受托资金       | 14,450,040,484.11 | 100,630,669,400.04 | 5,000,000,000.00 |
| 其中：自有资金投入    | 2,024,500,595.49  |                    |                  |
| 个人客户         | 3,223,764,269.33  | 483,496,000.00     |                  |
| 机构客户         | 9,201,775,619.29  | 100,147,173,400.04 | 5,000,000,000.00 |
| 期末受托资金       | 18,486,587,560.61 | 85,184,643,618.52  | 5,000,000,000.00 |
| 其中：自有资金投入    | 2,327,600,495.99  |                    |                  |
| 个人客户         | 3,875,596,922.21  | 473,496,000.00     |                  |
| 机构客户         | 12,283,390,142.41 | 84,711,147,618.52  | 5,000,000,000.00 |
| 期末主要受托资产初始成本 | 42,347,511,268.66 | 85,172,497,576.78  | 5,000,000,000.00 |
| 其中：股票        | 6,534,436.28      | 240,209,902.70     |                  |
| 债券           | 36,964,233,178.84 | 400,000,000.00     |                  |
| 基金及其他投资      | 5,376,743,653.54  | 84,532,287,674.08  | 5,000,000,000.00 |
| 当期资产管理业务净收入  | 9,670,847.84      | 19,530,883.98      | 943,396.23       |

**2016 年度 1-6 月**

| 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  | 32                | 162               | —        |
| 期末客户数量  | 16,926.00         | 79                | —        |
| 其中：个人客户 | 16,814.00         | 7                 | —        |
| 机构客户    | 112               | 72                | —        |
| 年初受托资金  | 10,380,343,670.76 | 72,613,727,843.97 | —        |

|              |                   |                   |   |
|--------------|-------------------|-------------------|---|
| 其中：自有资金投入    | 1,119,179,117.94  |                   | — |
| 个人客户         | 3,930,364,212.47  | 334,496,000.00    | — |
| 机构客户         | 5,330,800,340.35  | 72,279,231,843.97 | — |
| 期末受托资金       | 15,481,077,740.14 | 77,977,829,235.78 | — |
| 其中：自有资金投入    | 1,931,496,702.14  |                   | — |
| 个人客户         | 3,716,980,557.51  | 381,000,000.00    | — |
| 机构客户         | 9,832,600,480.49  | 77,596,829,235.78 | — |
| 期末主要受托资产初始成本 | 31,303,330,950.28 | 77,967,503,514.48 | — |
| 其中：股票        | 53,849,285.94     | 102,174,278.70    | — |
| 债券           | 25,266,592,822.90 |                   | — |
| 基金及其他投资      | 5,982,888,841.44  | 77,865,329,235.78 | — |
| 当期资产管理业务净收入  | 10,931,481.23     | 8,992,723.06      | — |

#### 41、利息净收入

| 项 目           | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>利息收入</b>   | <b>973,813,137.62</b> | <b>887,228,705.25</b> |
| 存放金融同业利息收入    | 295,056,174.06        | 209,788,142.54        |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 173,868,501.86        | 53,101,844.73         |
| 客户资金存款利息收入    | 121,187,672.20        | 156,686,297.81        |
| 融资融券利息收入      | 465,823,081.81        | 463,250,634.29        |
| 买入返售金融资产利息收入  | 210,081,914.28        | 203,114,904.70        |
| 其中：约定购回利息收入   | 13,950,755.96         | 21,656,592.34         |
| 股票质押回购利息收入    | 182,507,452.58        | 176,428,515.73        |
| 委托贷款利息收入      |                       | 9,016,824.01          |
| 其他            | 2,851,967.47          | 2,058,199.71          |
| <b>利息支出</b>   | <b>520,833,529.88</b> | <b>508,828,153.91</b> |
| 客户资金存款利息支出    | 20,890,001.70         | 28,600,023.56         |
| 卖出回购金融资产利息支出  | 101,544,223.48        | 122,675,741.93        |
| 其中：报价回购利息支出   | 762,491.81            | 1,198,101.02          |
| 拆入资金利息支出      | —                     | —                     |

|              |                       |                       |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 其中：转融通利息支出   | —                     | —                     |
| 应付债券利息支出     | 385,691,865.23        | 349,882,141.77        |
| 其中：次级债券利息支出  | 99,288,797.29         | 241,810,218.60        |
| 收益凭证利息支出     | 115,868,206.16        | 108,071,923.17        |
| 银行借款利息支出     | 12,579,995.33         | 7,252,684.85          |
| 其他           | 127,444.14            | 417,561.80            |
| <b>利息净收入</b> | <b>452,979,607.74</b> | <b>378,400,551.34</b> |

## 42、投资收益

### (1) 投资收益按类别列示

| 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          | 38,917,223.32         | 30,316,360.23         |
| 金融工具投资收益                | 817,093,457.71        | 537,641,141.40        |
| 其中：持有期间取得的收益            | 678,254,563.73        | 383,038,244.37        |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 13,529,496.05         | 10,328,729.19         |
| -持有至到期投资                | 778,579.96            | 1,586,918.06          |
| -可供出售金融资产               | 663,946,487.72        | 371,122,597.12        |
| -衍生金融工具                 |                       |                       |
| 处置金融工具取得的收益             | 147,067,704.78        | 145,786,728.12        |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 51,718,462.75         | 19,428,204.14         |
| -持有至到期投资                |                       |                       |
| -可供出售金融资产               | 95,349,242.03         | 126,358,523.98        |
| -衍生金融工具                 |                       |                       |
| 套期保值取得的投资收益             | -8,228,810.80         | 8,816,168.91          |
| 其他                      |                       | 0.00                  |
| <b>合 计</b>              | <b>856,010,681.03</b> | <b>567,957,501.63</b> |

(2) 投资收益汇回无重大限制。

(3) 权益法核算的长期股权投资投资收益

| 被投资单位 | 本期发生额 | 上期发生额 | 本期比上期增减变动的原因 |
|-------|-------|-------|--------------|
|-------|-------|-------|--------------|

|                         |                      |                      |           |
|-------------------------|----------------------|----------------------|-----------|
| 长盛基金管理有限公司              | 31,193,726.38        | 28,101,848.16        | 本报告期净利润增长 |
| 安徽安元投资基金有限公司            | 1,651,605.83         | -232,923.71          | 本报告期净利润增长 |
| 安徽安元投资基金管理有限公司          | 4,447,128.00         | 2,447,435.78         | 本报告期净利润增长 |
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 1,624,763.11         | —                    | 本报告期净利润增长 |
| <b>合 计</b>              | <b>38,917,223.32</b> | <b>30,316,360.23</b> |           |

（4）投资收益本报告期较去年同期增长 50.72%，主要系合并结构化主体所致。

#### 43、公允价值变动收益

| 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 | 15,508,814.74          | -20,862,974.50         |
| 转入被套期项目公允价值变动收益        | 1,984,941.32           | -18,922,883.69         |
| 股指期货公允价值变动收益           | -2,564,600.00          | -5,488,960.00          |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | -359,082,675.69        | -237,097,121.83        |
| <b>合 计</b>             | <b>-344,153,519.63</b> | <b>-282,371,940.02</b> |

#### 44、其他业务收入

| 项 目        | 本期发生额                | 上期发生额               |
|------------|----------------------|---------------------|
| 出租收入       | 6,046,373.19         | 5,107,207.21        |
| 其他收入       | 8,384,167.33         | 2,452,884.70        |
| <b>合 计</b> | <b>14,430,540.52</b> | <b>7,560,091.91</b> |

其他业务收入本报告期较去年同期增长 90.88%，主要系出租房产收入增加所致。

#### 45、税金及附加

| 项 目        | 本期发生额                | 上期发生额                |
|------------|----------------------|----------------------|
| 营业税        | —                    | 55,896,344.34        |
| 城建税        | 4,507,740.54         | 5,544,465.76         |
| 教育费附加      | 3,214,827.22         | 3,957,146.97         |
| 房产税        | 6,744,869.90         | —                    |
| 水利基金       | 712,804.27           | —                    |
| 其 他        | 984,165.70           | 1,240,864.14         |
| <b>合 计</b> | <b>16,164,407.63</b> | <b>66,638,821.21</b> |

税金及附加本报告期较去年同期下降 75.74%，主要系营业税改增值税所致。

#### 46、业务及管理费

##### (1) 费用项目

| 项 目    | 本期发生额          | 上期发生额          |
|--------|----------------|----------------|
| 业务及管理费 | 892,219,914.55 | 745,912,412.87 |

##### (2) 前十位费用项目

| 项 目         | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-------------|----------------|----------------|
| 工资、奖金、津贴、补贴 | 570,604,969.11 | 444,954,776.38 |
| 折旧费         | 44,860,285.80  | 47,665,125.07  |
| 社会保险费       | 42,240,494.64  | 37,574,470.54  |
| 租赁费         | 31,438,606.57  | 24,313,541.32  |
| 业务招待费       | 19,370,833.22  | 16,446,579.55  |
| 福利费         | 16,848,911.04  | 15,691,681.81  |
| 邮电通讯费       | 15,930,975.14  | 15,336,722.97  |
| 车辆使用费       | 14,338,173.35  | 12,877,935.45  |
| 住房公积金       | 13,407,616.52  | 13,243,174.43  |
| 差旅费         | 10,180,652.66  | 7,980,553.74   |

#### 47、资产减值损失

| 项 目          | 本期发生额          | 上期发生额          |
|--------------|----------------|----------------|
| 坏账损失         | 687,025.15     | 2,153,035.82   |
| 可供出售金融资产减值准备 | -26,675,488.18 | 570,561.00     |
| 融出资金减值准备     | 2,323,010.31   | -25,083,202.39 |
| 买入返售金融资产     | 12,164,093.41  | 9,189,635.00   |
| 合 计          | -11,501,359.31 | -13,169,970.57 |

#### 48、其他业务成本

| 项 目  | 本期发生额        | 上期发生额        |
|------|--------------|--------------|
| 开户费  | 3,688,952.47 | 1,401,299.78 |
| 转托管费 | 2,414.66     | 8,541.72     |



|            |                     |                     |
|------------|---------------------|---------------------|
| 其他         | 405,092.13          | 206,085.84          |
| <b>合 计</b> | <b>4,096,459.26</b> | <b>1,615,927.34</b> |

其他业务成本本期较上期增长 153.51%，主要系开户费大幅增加所致。

#### 49、营业外收入

##### (1) 营业外收入明细情况

| 项 目         | 本期发生额               | 上期发生额                | 计入本期非经常性损益的金额       |
|-------------|---------------------|----------------------|---------------------|
| 非流动资产处置利得合计 | 235,199.66          | 112,803.10           | 235,199.66          |
| 其中：处置固定资产利得 | 235,199.66          | 112,803.10           | 235,199.66          |
| 政府补助        | 5,877,200.00        | 13,529,844.90        | 5,877,200.00        |
| 其他          | 136,514.20          | 577,145.55           | 136,514.20          |
| <b>合 计</b>  | <b>6,248,913.86</b> | <b>14,219,793.55</b> | <b>6,248,913.86</b> |

##### (2) 计入当期损益的政府补助

| 补助项目       | 本期发生额               | 上期发生额                | 与资产相关/与收益相关 |
|------------|---------------------|----------------------|-------------|
| 扶持产业发展资金   | 800,000.00          | 8,130,000.00         | 与收益相关       |
| 税收返还款      | 3,075,200.00        | 1,992,118.37         | 与收益相关       |
| 金融发展专项资金   | 2,000,000.00        | 766,000.00           | 与收益相关       |
| 其他         | 2,000.00            | 2,641,726.53         | 与收益相关       |
| <b>合 计</b> | <b>5,877,200.00</b> | <b>13,529,844.90</b> |             |

(3) 营业外收入本报告期较去年同期下降 56.05%，主要系补贴收入大幅下降所致。

#### 50、营业外支出

| 项 目         | 本期发生额               | 上期发生额               | 计入本期非经常性损益的金额       |
|-------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 非流动资产处置损失合计 | 74,495.26           | 202,442.56          | 74,495.26           |
| 其中：固定资产处置损失 | 74,495.26           | 202,442.56          | 74,495.26           |
| 对外捐赠        | 5,200,000.00        | 3,555,000.00        | 5,200,000.00        |
| 违约金和赔偿损失    | 41,363.63           | 114.00              | 41,363.63           |
| 滞纳金、罚款      | 42,777.03           | 64,705.66           | 42,777.03           |
| 其他          | 166,631.50          | 18,603.62           | 166,631.50          |
| <b>合 计</b>  | <b>5,525,267.42</b> | <b>3,840,865.84</b> | <b>5,525,267.42</b> |

营业外支出本报告期较去年同期增长 43.85%，主要系对外捐赠增加所致。

## 51、所得税费用

### (1) 所得税费用的组成

| 项 目        | 本期发生额                 | 上期发生额                |
|------------|-----------------------|----------------------|
| 当期所得税费用    | 108,925,109.07        | 44,338,877.54        |
| 递延所得税费用    | 44,742,477.51         | 54,124,007.72        |
| <b>合 计</b> | <b>153,667,586.58</b> | <b>98,462,885.26</b> |

### (2) 所得税费用（收益）与会计利润关系的说明

| 项 目                            | 本期发生额                 | 上期发生额                |
|--------------------------------|-----------------------|----------------------|
| 利润总额                           | 671,356,241.63        | 612,208,979.17       |
| 按法定税率（25%）计算的所得税费用             | 167,839,060.41        | 153,052,244.80       |
| 子公司适用不同税率的影响                   | -4,444,813.22         | -2,391,417.73        |
| 调整以前期间所得税的影响                   | 5,015,165.10          | -41,092,278.41       |
| 非应税收入的影响                       | -14,167,137.51        | -8,385,575.74        |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响               | 1,947,777.58          | 3,267,515.19         |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响        |                       |                      |
| 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 |                       |                      |
| 其他                             | -2,522,465.78         | -5,987,602.85        |
| <b>所得税费用</b>                   | <b>153,667,586.58</b> | <b>98,462,885.26</b> |

(3) 所得税费用本报告期较去年同期增长 56.07%，主要系应纳企业所得税额增加，相应计提的当期所得税费用增加所致。

## 52、现金流量表项目注释

### (1) 收到其他与经营活动有关的现金

| 项 目   | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-------|----------------|----------------|
| 证券清算款 | 333,773,818.45 | 116,806,232.98 |
| 暂收款   | 139,078,277.85 |                |
| 政府补助  | 5,877,200.00   | 14,106,990.45  |

|              |                       |                       |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 提供租赁等服务收到的现金 | 6,046,373.19          | 7,560,091.91          |
| 委托贷款         | 0.00                  | 34,000,000.00         |
| 其他           | 109,059,415.79        | 22,987,836.69         |
| <b>合 计</b>   | <b>593,835,085.28</b> | <b>195,461,152.03</b> |

## (2) 支付其他与经营活动有关的现金

| 项 目        | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 支付存出保证金    | 5,757,533.56          | 7,007,432.13          |
| 租赁费        | 31,438,606.57         | 24,313,541.32         |
| 邮电通讯费      | 15,930,975.14         | 15,336,722.97         |
| 业务招待费      | 19,370,833.22         | 16,446,579.55         |
| 咨询费        | 9,723,468.81          | 5,862,887.28          |
| 车辆使用费      | 14,338,173.35         | 12,877,935.45         |
| 水电费        | 6,668,403.34          | 7,570,164.87          |
| 差旅费        | 10,180,652.66         | 7,980,553.74          |
| 电子设备运转费    | 7,186,515.79          | 7,565,360.37          |
| 交易所会员交易流量费 | 1,616,646.99          | 5,853,373.86          |
| 办公费        | 4,091,283.30          | 3,048,548.95          |
| 其他         | 29,631,192.71         | 54,245,973.78         |
| <b>合 计</b> | <b>155,934,285.44</b> | <b>168,109,074.27</b> |

## (3) 收到其他与投资活动有关的现金

| 项 目                 | 本期发生额               | 上期发生额             |
|---------------------|---------------------|-------------------|
| 处置固定资产等长期资产所收回的现金净额 | 1,761,460.73        | 241,418.31        |
| <b>合 计</b>          | <b>1,761,460.73</b> | <b>241,418.31</b> |

## (4) 支付其他与筹资活动有关的现金

| 项 目            | 本期发生额    | 上期发生额                 |
|----------------|----------|-----------------------|
| 发行债券而支付的审计、咨询费 | —        | 1,950,024.94          |
| 回购库存股          | —        | 397,160,856.60        |
| <b>合 计</b>     | <b>—</b> | <b>399,110,881.54</b> |

### 53、现金流量表补充资料

#### (1) 现金流量表补充资料

| 项 目                                   | 本期发生额             | 上期发生额             |
|---------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 1、将净利润调节为经营活动现金流量                     |                   |                   |
| 净利润                                   | 517,688,655.05    | 513,746,093.91    |
| 加：资产减值准备                              | -11,501,359.31    | -13,169,970.57    |
| 固定资产折旧                                | 44,860,285.80     | 47,665,125.07     |
| 无形资产摊销                                | 8,971,741.80      | 8,172,078.75      |
| 长期待摊费用摊销                              | 5,924,398.24      | 8,807,872.96      |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失<br>（收益以“-”号填列）  | -160,704.40       | 89,639.46         |
| 固定资产报废损失（收益以“-”号填列）                   | —                 | —                 |
| 公允价值变动损失（收益以“-”号填列）                   | 341,588,939.63    | 33,611,576.51     |
| 利息支出（收益以“-”号填列）                       | 398,271,860.56    | 349,882,141.77    |
| 汇兑损失（收益以“-”号填列）                       | -5,002,563.26     | -8,070,832.26     |
| 投资损失（收益以“-”号填列）                       | -38,917,223.32    | -30,316,360.23    |
| 递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）                  | 36,642,286.37     | 59,778,981.40     |
| 递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）                  | 8,100,191.14      | -5,654,973.68     |
| 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） | -414,234,294.17   | -1,949,025,878.91 |
| 经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）                 | -2,476,269,206.93 | 2,690,380,728.35  |
| 经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）                 | 2,310,229,019.98  | -3,182,436,732.99 |
| 其 他                                   |                   |                   |
| 经营活动产生的现金流量净额                         | 726,192,027.18    | -1,476,540,510.46 |
| 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                               | 19,845,841,464.93 | 22,621,123,220.56 |

|              |                   |                   |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 减：现金的期初余额    | 21,011,546,881.27 | 27,971,971,621.64 |
| 加：现金等价物的期末余额 | —                 | —                 |
| 减：现金等价物的期初余额 | —                 | —                 |
| 现金及现金等价物净增加额 | -1,165,705,416.34 | -5,350,848,401.08 |

(2) 现金和现金等价物

| 项 目            | 期末余额              | 期初余额              |
|----------------|-------------------|-------------------|
| 一、现 金          | 19,845,841,464.93 | 21,011,546,881.27 |
| 其中：库存现金        | 812,840.17        | 594,600.38        |
| 可随时用于支付的银行存款   | 16,699,517,381.60 | 18,047,114,460.87 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | 9,753,978.74      | 38,081,535.93     |
| 结算备付金          | 3,135,757,264.42  | 2,925,756,284.09  |
| 二、现金等价物        |                   |                   |
| 其中：三个月内到期的债券投资 | —                 | —                 |
| 三、期末现金及现金等价物余额 | 19,845,841,464.93 | 21,011,546,881.27 |

54、所有权或使用权受到限制的资产

| 项 目    | 期末账面价值                   | 受限原因          |
|--------|--------------------------|---------------|
| 债券     | 9,024,649,865.84         | 卖出回购金融资产款的担保物 |
| 融资融券债权 | 1,731,131,610.65         | 卖出回购金融资产款的担保物 |
| 银行存款   | 6,000,000.00             | 被冻结           |
| 合 计    | <b>10,761,781,476.49</b> |               |

55、外币货币性项目

| 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  |                  |         |                         |
| 其中：美元 | 82,347,614.98    | 6.7744  | 557,855,682.93          |
| 港币    | 1,860,425,030.32 | 0.86792 | 1,614,700,092.27        |
| 小计    | —                | —       | <b>2,172,555,775.20</b> |
| 结算备付金 |                  |         |                         |
| 其中：美元 | 10,082,238.04    | 6.7744  | 68,301,113.38           |

|    |               |         |                         |
|----|---------------|---------|-------------------------|
| 港币 | 39,577,213.77 | 0.86792 | 34,349,855.38           |
| 小计 | —             | —       | <b>102,650,968.76</b>   |
| 合计 | —             | —       | <b>2,275,206,743.96</b> |

## 六、合并范围的变更

本报告期内增加、减少子公司、结构化主体情况详见本附注一、2（3）。

## 七、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

| 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 |            |
| 国元香港  | 香港    | 香港  | 证券经纪、自营业务 | 100     | —  | 投资设立       |
| 国元直投  | 上海    | 上海  | 投资业务      | 100     | —  | 投资设立       |
| 国元期货  | 北京    | 北京  | 期货经纪业务    | 98.41   | —  | 非同一控制下企业合并 |
| 国元创新  | 合肥    | 合肥  | 投资业务      | 100     | —  | 投资设立       |
| 股交中心  | 合肥    | 合肥  | 股权登记托管业务  | 50      | —  | 非同一控制下企业合并 |

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位的依据：

本公司持有股交中心 50%的股权比例，且股交中心的主要经营管理层由本公司委派，直接负责股交中心的经营决策和财务等主要事项，故本公司可以控制股交中心。

#### （2）纳入合并范围的结构化主体

| 序号 | 结构化主体全称              | 期末集合资产总<br>份额    | 自有资金期末<br>份额比例(%) | 取得方式 |
|----|----------------------|------------------|-------------------|------|
| 1  | 国元黄山 1 号限定型集合资产管理计划  | 23,475,651.55    | 15.56%            | 设立   |
| 2  | 国元利贞限额特定集合资产管理计划     | 1,754,646.47     | 100.00%           | 设立   |
| 3  | 国元浦江 1 号债券分级集合资产管理计划 | 3,107,597,082.80 | 15.00%            | 设立   |
| 4  | 国元创新驱动集合资产管理计划       | 10,105,236.11    | 16.05%            | 设立   |
| 5  | 国元元赢 1 号债券分级集合资产管理计划 | 1,036,067,239.97 | 15.09%            | 设立   |
| 6  | 国元元赢 3 号债券分级集合资产管理计划 | 3,408,639,077.17 | 15.01%            | 设立   |

|    |                      |                  |         |    |
|----|----------------------|------------------|---------|----|
| 7  | 国元元赢 4 号债券分级集合资产管理计划 | 472,375,901.48   | 15.32%  | 设立 |
| 8  | 国元元赢 6 号债券分级集合资产管理计划 | 823,731,421.34   | 15.02%  | 设立 |
| 9  | 国元元赢 11 号集合资产管理计划    | 1,177,006,916.49 | 15.04%  | 设立 |
| 10 | 国元元赢 16 号集合资产管理计划    | 2,720,793,623.73 | 15.10%  | 设立 |
| 11 | 国元证券招元 7 号定向资产管理计划   | 4,200,000.00     | 100.00% | 设立 |
| 12 | 国元证券元中 26 号定向资产管理计划  | 30,000,000.00    | 100.00% | 设立 |
| 13 | 国元证券元中 27 号定向资产管理计划  | 140,000,000.00   | 100.00% | 设立 |
| 14 | 国元证券元惠 37 号定向资产管理计划  | 42,000,000.00    | 100.00% | 设立 |
| 15 | 国元证券元惠 38 号定向资产管理计划  | 8,000,000.00     | 100.00% | 设立 |
| 16 | 国元证券元惠 39 号定向资产管理计划  | 195,000,000.00   | 100.00% | 设立 |
| 17 | 国元元赢 19 号集合资产管理计划    | —                | —       | 设立 |
| 18 | 国元元赢 13 号集合资产管理计划    | —                | —       | 设立 |

注：国元元赢 13 号、元赢 19 号于本报告期清算。

### (3) 重要的非全资子公司

| 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     |
|-------|----------|--------------|----------------|----------------|
| 国元期货  | 1.59%    | 168,954.14   | —              | 10,708,081.58  |
| 股交中心  | 50%      | 3,862,974.47 | 10,000,000.00  | 125,968,988.71 |

### (4) 重要非全资子公司的主要财务信息

| 子公司名称 | 期末余额/本期发生额       |                |               |               |               |                |
|-------|------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
|       | 资产合计             | 负债合计           | 营业收入          | 净利润           | 综合收益总额        | 经营活动现金流量       |
| 国元期货  | 1,632,415,211.12 | 958,950,960.68 | 51,395,025.68 | 10,626,046.61 | 13,757,752.16 | -30,838,679.80 |
| 股交中心  | 460,955,258.04   | 212,211,316.99 | 18,262,703.77 | 7,667,459.50  | 7,667,459.50  | 124,595,134.02 |

(续上表)

| 子公司名称 | 期初余额/上期发生额       |                |               |              |              |                |
|-------|------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|----------------|
|       | 资产合计             | 负债合计           | 营业收入          | 净利润          | 综合收益总额       | 经营活动现金流量       |
| 国元期货  | 1,557,841,189.46 | 898,134,691.18 | 38,688,976.70 | 7,260,849.83 | 7,231,365.48 | 216,891,597.01 |
| 股交中心  | 347,054,621.24   | 85,978,139.69  | 11,832,053.96 | 6,171,011.01 | 6,170,947.94 | 46,016,559.85  |

## 2、在联营企业中的权益

(1) 重要的联营企业

| 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    |                     |
| 长盛基金管理有限公司              | 北京    | 深圳  | 基金管理业务；发起设立基金     | 41.00   | —     | 权益法                 |
| 安徽安元投资基金有限公司            | 合肥    | 合肥  | 股权投资、基金投资业务       | 43.33   | —     | 权益法                 |
| 安徽安元投资基金管理有限公司          | 合肥    | 合肥  | 受托管理股权投资基金企业的投资业务 | 30.00   | —     | 权益法                 |
| 合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 合肥    | 合肥  | 股权投资、投资管理及投资咨询    | —       | 21.90 | 权益法                 |

(2) 重要联营企业的主要财务信息

| 项 目                  | 长盛基金管理有限公司       |                  |
|----------------------|------------------|------------------|
|                      | 期末余额/ 本期发生额      | 期初余额/ 上期发生额      |
| 资产合计                 | 1,365,588,089.78 | 1,295,646,846.05 |
| 负债合计                 | 292,468,883.78   | 262,595,836.88   |
| 少数股东权益               | —                | —                |
| 归属于母公司股东权益           | 1,073,119,206.00 | 1,033,051,009.17 |
| 按持股比例计算的净资产份额        | 439,978,874.46   | 423,550,913.76   |
| 调整事项                 | —                | —                |
| —其他                  | 38,358,391.24    | 38,358,391.24    |
| 对联营企业权益投资的账面价值       | 478,337,265.70   | 461,909,305.00   |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | —                | —                |
| 营业收入                 | 299,660,668.41   | 266,556,464.54   |
| 净利润                  | 77,308,872.45    | 72,792,278.91    |
| 其他综合收益               | 8,759,324.39     | -7,422,152.38    |
| 综合收益总额               | 86,068,196.84    | 65,370,126.53    |
| 本年度收到的来自联营企业的股利      | 18,860,000.00    | 30,996,000.00    |
| 项 目                  | 安徽安元投资基金有限公司     |                  |
|                      | 期末余额/ 本期发生额      | 期初余额/ 上期发生额      |
| 资产合计                 | 3,743,772,902.38 | 3,391,171,930.29 |
| 负债合计                 | 8,796,405.10     | 8,318,745.21     |



|                      |                                |                  |
|----------------------|--------------------------------|------------------|
| 少数股东权益               | 698,025,533.80                 | 349,713,531.09   |
| 归属于母公司股东权益           | 3,036,950,963.48               | 3,033,139,653.99 |
| 按持股比例计算的净资产份额        | 1,316,012,084.17               | 1,314,360,406.26 |
| 调整事项                 | —                              | —                |
| —其他                  | —                              | —                |
| 对联营企业权益投资的账面价值       | 1,316,012,084.17               | 1,314,360,406.26 |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | —                              | —                |
| 营业收入                 | 29,992,526.32                  | 13,556,583.45    |
| 净利润                  | 2,123,312.20                   | -537,517.99      |
| 其他综合收益               | —                              | —                |
| 综合收益总额               | 2,123,312.20                   | -537,517.99      |
| 本年度收到的来自联营企业的股利      | —                              | —                |
| 项 目                  | <b>安徽安元投资基金管理有限公司</b>          |                  |
|                      | 期末余额/ 本期发生额                    | 期初余额/ 上期发生额      |
| 资产合计                 | 79,762,886.37                  | 66,198,826.02    |
| 负债合计                 | 1,876,239.92                   | 3,135,939.59     |
| 少数股东权益               | —                              | —                |
| 归属于母公司股东权益           | 77,886,646.45                  | 63,062,886.43    |
| 按持股比例计算的净资产份额        | 23,365,993.94                  | 18,918,865.94    |
| 调整事项                 | —                              | —                |
| —其他                  | —                              | —                |
| 对联营企业权益投资的账面价值       | 23,365,993.94                  | 18,918,865.94    |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | —                              | —                |
| 营业收入                 | 26,603,202.74                  | 16,656,889.93    |
| 净利润                  | 14,823,760.02                  | 8,158,119.26     |
| 其他综合收益               | —                              | —                |
| 综合收益总额               | 14,823,760.02                  | 8,158,119.26     |
| 本年度收到的来自联营企业的股利      | —                              | —                |
| 项 目                  | <b>合肥中电科国元产业投资基金合伙企业（有限合伙）</b> |                  |

|                      | 期末余额/ 本期发生额      | 期初余额/ 上期发生额      |
|----------------------|------------------|------------------|
| 资产合计                 | 1,325,313,019.29 | 1,318,025,022.60 |
| 负债合计                 | 103,773.62       | 37,358.50        |
| 少数股东权益               | —                | —                |
| 归属于母公司股东权益           | 1,325,209,245.67 | 1,317,987,664.10 |
| 按持股比例计算的净资产份额        | 301,184,061.54   | 288,609,298.43   |
| 调整事项                 |                  | 10,950,000.00    |
| —其他                  | —                | —                |
| 对联营企业权益投资的账面价值       | 301,184,061.54   | 299,559,298.43   |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | —                | —                |
| 营业收入                 | 20,555,887.66    | —                |
| 净利润                  | 7,221,581.57     | —                |
| 其他综合收益               | —                | —                |
| 综合收益总额               | 7,221,581.57     | —                |
| 本年度收到的来自联营企业的股利      | —                | —                |

### 3、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本公司发起设立的资产管理计划，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。本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权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。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

| 序号 | 集合名称               | 业务性质   | 财务报表中确认的与结构化主体中权益相关的资产 | 自有资金投资比例 | 财务报表中确认的与结构化主体中权益相关的资产的年末余额 | 在结构化主体中权益的最大损失敞口 |
|----|--------------------|--------|------------------------|----------|-----------------------------|------------------|
| 1  | 国元黄山3号集合资产管理计划     | 资产管理业务 | 可供出售金融资产               | 15.03%   | 4,452,048.60                | 4,452,048.60     |
| 2  | 国元元赢2号债券分级集合资产管理计划 | 资产管理业务 | 可供出售金融资产               | 15.00%   | 160,118,140.31              | 160,118,140.31   |
| 3  | 国元元赢28号集合资产管理计划    | 资产管理业务 | 可供出售金融资产               | 3.48%    | 18,274,520.00               | 18,274,520.00    |
| 4  | 国元元赢27号集合资产管理计划    | 资产管理业务 | 可供出售金融资产               | 14.86%   | 181,389,729.60              | 181,389,729.60   |

|   |                           |        |          |        |                       |                       |
|---|---------------------------|--------|----------|--------|-----------------------|-----------------------|
| 5 | 国元元福 1 号量化对冲 FOF 集合资产管理计划 | 资产管理业务 | 可供出售金融资产 | 10.07% | 11,231,360.00         | 11,231,360.00         |
| 6 | 国元方富新三板 1 号集合资产管理计划       | 资产管理业务 | 可供出售金融资产 | 6.57%  | 1,946,124.58          | 1,946,124.58          |
| 7 | 国元睿丰 1 号集合资产管理计划          | 资产管理业务 | 可供出售金融资产 | 5.05%  | 80,629,436.92         | 80,629,436.92         |
|   | <b>合 计</b>                |        |          |        | <b>458,041,360.01</b> | <b>458,041,360.01</b> |

## 八、与金融工具相关的风险

### 1、风险管理政策和组织架构

#### (1) 风险管理政策

本公司风险管理的目标是促进公司业务经营持续健康发展，确保公司各项业务在可承受的风险范围内有序运作；保障公司资产和客户受托资产的安全完整；公司经营中整体风险可测、可控、可承受，最终实现公司的经营战略和发展目标。

本公司在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。公司制定了相应的政策和程序来识别和分析这些风险，并设定适当的风险指标、风险限额、风险政策及内部控制流程，通过信息系统持续监控管理上述各类风险。

#### (2) 风险管理组织架构

公司严格按照《公司法》、《证券法》和中国证监会有关法律、法规和准则的要求，不断完善和规范公司内部控制组织架构，建立了以公司股东大会、董事会、监事会为核心的风险控制体系。公司自设立以来注重内部控制机制和内部控制制度的建设，已形成比较规范的法人治理结构，形成了较为科学合理的决策、执行和监督机制。按照《公司法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》、《证券公司管理办法》、《证券公司内部控制指引》等法律法规、监管规定以及《公司章程》的规定，结合公司实际情况，制订并完善了各项内部控制制度，已建立环境控制、风险控制、业务控制、自有资金和财会系统管理控制、电子信息系统控制、人力资源与薪酬管理、信息沟通与披露的管理等内部控制体系。公司不断调整完善风险管理组织架构，并明确划分了各层的职能：

①本公司股东大会是公司的最高权力机构，能够确保所有股东，特别是中小股东享有平等地位，保障了所有股东能够依法充分行使权利。

②本公司董事会是公司的决策机构，对公司内部控制体系的建立健全负责，建立和完善内部控制的政策和程序，监督内部控制制度的执行。董事会下设董事会秘书负责处理董

事会日常事务。

③公司监事会是公司的监督机构，对董事、总经理及其他高管人员的行为及各子公司的财务状况进行监督及检查，并向股东大会负责并报告工作。

④公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会、发展战略委员会及薪酬与提名委员会。专门委员会成员全部由董事组成，其中审计委员会中独立董事占三分之二以上的比例。风险管理委员会主要负责对公司的总体风险管理进行监督，并将之控制在合理范围内，以确保本公司能够对与公司经营活动相关联的各种风险实施有效的管理。审计委员会主要负责对公司经营管理进行合规性控制，对公司内部稽核审计工作结果进行审查和监督。发展战略委员会主要负责对公司长远发展战略进行研究预测，制定公司发展战略计划。薪酬与考核委员会主要负责制定公司董事及高级管理人员的考核标准并进行考核；负责制定、审查公司董事及高级管理人员的薪酬政策与方案。各专门委员会对董事会负责，向董事会报告。

⑤本公司管理层对内部控制制度的制定和有效执行负责，通过指挥、协调、管理、监督各子公司和职能部门行使经营管理权力，保证公司的正常经营运转。各子公司和职能部门实施具体经营业务，管理公司日常事务。为更好地对公司日常事务进行管理和协调，公司管理层设立了风控与合规委员会、绩效考核委员会、自营业务领导小组、信息技术治理委员会和投行项目内核小组等非常设议事机构。

⑥根据《证券公司监督管理条例》的规定，公司聘任了合规总监和首席风险官，按事前、事中、事后监督设立独立于公司其他部门的合规管理部、风险监管部和稽核部，作为公司内部监督检查部门履行监督检查职责，对董事会负责，向董事会报告工作。风险监管部负责倡导全员风险意识，进行公司风险管理体系和策略的研究；针对市场风险、信用风险、操作风险等风险类型，及时识别已开展的各项业务和创新业务可能存在的风险，督导业务部门在业务运行、业务创新中建立与完善各项内部控制制度和风险管理流程；通过连接各业务管理系统、建设电子信息监控系统，对公司经营活动、业务开展事前和事中的风险监管点或风险监管项目实施审核、监控与管理；建立风险控制指标监控体系，组织进行全面压力测试和专项压力测试工作；按照公司有关规定与子公司进行风险监管对接；建立风险监管信息内部报送与传递机制，修正偏差以达到风险的分担、转移、整合和消除。合规管理部负责督导和协助经理层有效管理公司各业务法律风险和合规风险，对公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查，履行合规政策开发、合规审查、合规咨询、监督检查、培训教育等合规支持和合规控制职责；负责对公司的业务开

展及合同内容的合法性、约定权利义务的对等性、条款的完备性以及是否存在重大缺陷或显失公平等法律事项进行审核；对已获准的合同及业务提供相应的法律服务；管理公司的诉讼案件；协助司法机关查询、冻结及执行工作；配合公司相关部门开展专项法律培训，防范法律风险。稽核部负责对公司所属部门及分支机构的业务、财务、会计及其他经营管理活动的合法性、合规性、真实性、效益性等履行检查、评价、报告和建议职能。

## 2、信用风险

### (1) 本公司面临的信用风险及其具体表现情况

信用风险是指债务人、交易对手未能履行合同所规定的义务或由于信用评级的变动和履约能力的变化导致债务方不履行偿还义务或造成市场价值变动，从而对本公司造成损失的可能性。本公司面临信用风险的资产主要包括：①固定收益类金融资产及衍生金融资产；②融资融券款及买入返售金融资产(主要由约定式购回业务和股票质押式回购业务形成)；③购买的其他金融机构管理的金融资产（主要由国元创新投资公司等子公司购买的信托产品及委托贷款）。

固定收益类金融资产包括货币资金、结算备付金、应收款项类投资和债券投资等，其信用风险主要指交易对手违约风险和标的证券发行主体违约风险，最大的信用风险敞口等于这些工具的账面金额。

本公司进行的证券回购交易亦会产生一定信用风险，但绝大多数回购为交易所新质押式国债回购及交易所担保交收，故由此产生的信用风险并不大。

融资类业务方面，融资融券业务信用风险敞口包括客户融资买入和融券卖出所产生的负债，约定购回式证券交易业务和股票质押式回购业务的信用风险敞口主要是指融资方提供担保品并从本公司融出资金而产生的负债。这些金融资产主要的信用风险来自于交易对手未能及时偿还债务本息而违约的风险。2017年06月30日，本公司所有融资融券有负债客户的平均维持担保比例为256.68% (2016年12月31日：314.31%)，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为169.80% (2016年12月31日：219.69%)，股票质押式回购业务(资金融出方为证券公司)客户的平均履约保障比例为226.38% (2016年12月31日：294.16%)，提交担保品充足，融资类业务信用风险可控。

### (2) 对信用风险进行管理

本公司对债券投资业务信用风险的管理主要借助评级管理、交易限额、持仓限额、发行人敞口限额等手段，评估要素包括但不限于：发行人主体评级、债项评级、担保人评级、

基本面信息、重大负面信息等。

本公司对场外衍生品业务交易对手信用风险的管理措施包括运用 DVP 交收、抵押品、担保、信用衍生工具等措施进行交易对手风险的缓释甚至消除，及通过评级管理、客户准入条件设定、授信额度控制、单笔交易权限设置、投资限额控制等相关交易对手信用风险进行管理。

本公司对融资类业务的信用风险的管理主要通过：①建立严格的业务尽职调查要求，建立并不断完善客户信用评级体系、授信管理办法，制定业务准入标准，于业务开展前对交易对手的信用状况和业务资质进行审查，初步识别和评估业务信用风险，加强客户的适当性管理；②研究制定三级业务审核流程，对拟开展业务的交易对手、担保品和其他交易要素先由业务部门进行独立审慎评估，后提交公司专门审核小组评审，充分识别业务信用风险，并有针对性地采取风险缓释措施，最后报经公司主要领导批准；③业务开展后对交易对手、担保品及交易协议的实际履行情况进行持续的贷后跟踪管理，定期搜集业务相关信息资料并评估风险，发生风险事件时及时采取应对处理措施。

本公司积极探索利用缓释工具对信用风险进行缓释，以有效控制信用风险。缓释工具包括但不限于：抵质押品、第三方担保、抵销安排和其他对冲工具、设定严格的信用契约条款等。

若不考虑担保品或其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面金额(即，扣除减值准备后的净额)。本公司最大信用风险敞口金额列示如下：

| 项 目                       | 期末余额              | 期初余额              |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 货币资金                      | 16,716,084,200.51 | 18,091,790,597.18 |
| 结算备付金                     | 3,135,757,264.42  | 2,925,756,284.09  |
| 融出资金                      | 13,300,011,483.43 | 12,227,464,711.38 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（注） | 156,376,619.44    | 118,383,963.97    |
| 买入返售金融资产                  | 7,842,495,088.25  | 6,351,501,872.10  |
| 应收款项                      | 380,566,829.62    | 653,505,903.26    |
| 应收利息                      | 877,665,722.94    | 746,583,068.27    |
| 存出保证金                     | 48,450,613.03     | 42,693,079.47     |
| 可供出售金融资产（注）               | 20,860,042,786.57 | 16,607,263,197.95 |
| 其中：融出证券                   | 31,995,084.13     | 69,133,135.25     |

|            |                          |                          |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 持有至到期投资（注） | 18,858,165.76            | 19,435,696.00            |
| 委托贷款       | 339,200,000.00           | 307,000,000.00           |
| <b>合 计</b> | <b>63,675,508,773.97</b> | <b>58,091,378,373.67</b> |

注：上述以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债券投资，可供出售金融资产包含可供出售金融资产下的债券投资和融出证券业务下融出给客户的证券，持有至到期投资为债券投资。

### 3、市场风险

本公司金融工具的市场风险，是指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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

公司制订《风险偏好框架与政策》确定本公司对市场风险等风险偏好的定性描述和定量描述，针对不同业务的特点，为每一个具体业务设定量化的可接受指标，制定相关的投资规模限额和风险限额并分解到各部门，通过投资交易控制、敏感性分析、压力测试以及盈亏、集中度、流动性的监控的综合使用来管理市场风险。本公司由独立于业务部门的风险监管部对本公司整体的市场风险进行全面的评估、监测和管理，并将评估、监测结果向各业务部门、公司管理层和董事会进行汇报。在具体实施市场风险管理的过程中，前台业务部门作为市场风险的直接承担者和一线管理人员，动态管理其持仓部分所暴露出的市场风险，并在风险暴露较高时主动采取降低风险敞口或风险对冲等操作；而风险监管部的相关监控人员则会持续地直接与业务部门的团队沟通风险信息，讨论风险状态和极端损失情景等。同时，通过定期风险报告及时向公司管理层汇报公司整体及各业务部门的市场风险状况以及变化情况。

#### （1）利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本公司的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、委托贷款及债权投资等。本公司固定收益投资主要是中期票据、优质短期融资券、企业信用债等，主要采用压力测试和敏感度指标，计量监测固定收益投资组合久期、凸性等指标来衡量固定收益投资组合的利率风险。

利率敏感性分析：以下敏感性分析基于计息资产及负债的利率风险。该分析假设各有关期间报告期末结余的计息资产及负债一直持有至到期，在其他变量不变的情况下，利率增减 100 个基点对所得税前利润及所得税前其他综合收益的影响。下述正数表示所得税前利润及所得税前其他综合收益增加，反之则为亏损和收益减少。

| 项 目        | 本期             |                | 上期             |                |
|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|            | 对利润总额的影响       | 对其他综合收益的影响     | 对利润总额的影响       | 对其他综合收益的影响     |
| 上升 100 个基点 | 21,702,989.68  | 33,469,949.49  | 16,163,031.26  | 53,037,528.35  |
| 下降 100 个基点 | -21,702,989.68 | -33,469,949.49 | -16,163,031.26 | -53,037,528.35 |

### (2) 汇率风险

汇率风险主要为本公司的财务状况和现金流量受外汇汇率波动的影响。除了在香港设立的子公司持有以港币为结算货币的资产和负债外，只有代理 B 股业务产生的小额港币和美元资产，具体如下：

| 项 目         | 期末外币余额           | 折算汇率    | 期末折算人民币余额        | 期初外币余额           | 折算汇率   | 期初折算人民币余额        |
|-------------|------------------|---------|------------------|------------------|--------|------------------|
| 货币资金（美元）    | 10,923,329.25    | 6.77440 | 73,999,001.70    | 12,580,591.45    | 6.937  | 87,271,562.88    |
| 货币资金（港币）    | 41,919,708.25    | 0.86792 | 36,382,953.14    | 2,886,655,437.42 | 0.8945 | 2,582,113,645.64 |
| 结算备付金（美元）   | 10,082,238.04    | 6.77440 | 68,301,113.38    | 11,676,513.52    | 6.937  | 80,999,974.29    |
| 结算备付金（港币）   | 39,577,213.77    | 0.86792 | 34,349,855.38    | 43,756,469.68    | 0.8945 | 39,140,599.69    |
| 融出资金（港币）    | 2,574,691,979.96 | 0.86792 | 2,234,626,663.25 | 1,815,940,683.00 | 0.8945 | 1,624,358,940.94 |
| 交易性金融资产（港币） | 119,585,203.40   | 0.86792 | 103,790,389.74   | 108,326,980.00   | 0.8945 | 96,898,483.61    |
| 持有至到期投资     | 21,728,000.00    | 0.86792 | 18,858,165.76    | 21,728,000.00    | 0.8945 | 19,435,696.00    |
| 应收款项（港币）    | 73,575,604.03    | 0.86792 | 63,857,738.25    | 216,953,023.00   | 0.8945 | 194,064,479.07   |
| 短期借款（港币）    | 1,405,000,000.00 | 0.86792 | 1,219,427,600.00 | 1,090,000,000.00 | 0.8945 | 975,005,000.00   |
| 代理买卖证券款（港币） | 2,420,894,766.74 | 0.86792 | 2,101,142,985.95 | 2,551,103,695.00 | 0.8945 | 2,281,962,255.18 |
| 应付款项（港币）    | 102,311,101.63   | 0.86792 | 88,797,851.33    | 27,536,124.00    | 0.8945 | 24,631,062.92    |

于 2017 年 6 月 30 日，在所有其他变量保持不变的情况下，如果人民币对美元和港币升值或贬值 10%，则公司将增加或减少税前利润 5,620,705.31 人民币元（2016 年 12 月 31 日：6,311,097.57 人民币元），增加或减少税前其他综合收益 118,347,481.67 人民币元（2016 年 12 月 31 日：116,029,079.57 人民币元）。管理层认为合理反映了下一年度人民币对美元和港币可能发生变动的合理范围。

### (3) 其他价格风险

其他价格风险主要为股票价格、衍生金融工具价格等的不利变动使本公司表内和表外业务发生损失的风险。本公司该项风险在数量上表现为交易性金融工具的市价波动同比例



影响本公司的利润变动；可供出售金融工具的市价波动同比例影响本公司的股东权益变动。除了监测持仓、交易和盈亏指标外，本公司主要通过独立的风险监管部在日常监控中计量和监测证券投资组合的风险敏感度指标、压力测试指标。

其他价格敏感性分析：以下分析假设其他变量维持不变的情况下，股权证券、基金、可转换债券、衍生工具及集合资产管理计划的价格增加或减少 10%对所得税前利润及所得税前其他综合收益的影响。下述正数表示所得税前利润及所得税前其他综合收益增加，反之则为亏损和收益减少。

| 项 目      | 本期              |                 | 上期              |                   |
|----------|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|
|          | 对利润总额的影响        | 对其他综合收益的影响      | 对利润总额的影响        | 对其他综合收益的影响        |
| 市价上升 10% | 113,375,210.07  | 706,461,852.32  | 103,489,946.27  | 1,029,989,270.28  |
| 市价下降 10% | -113,375,210.07 | -706,461,852.32 | -103,489,946.27 | -1,029,989,270.28 |

#### 4、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。

母公司各项金融资产以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

| 项 目                    | 期末余额                     |                       |                         |                          |                         |          |                          |
|------------------------|--------------------------|-----------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|----------|--------------------------|
|                        | 即期                       | 1 个月以内                | 1-3 个月                  | 3 个月-1 年                 | 1-5 年                   | 5 年以上    | 合计                       |
| 货币资金                   | 13,252,222,081.18        |                       |                         |                          |                         |          | 13,252,222,081.18        |
| 结算备付金                  | 2,627,855,389.22         |                       |                         |                          |                         |          | 2,627,855,389.22         |
| 融出资金                   |                          | 347,118,059.81        | 1,950,673,657.16        | 8,823,343,876.19         |                         |          | 11,121,135,593.16        |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 769,018,498.48           |                       |                         |                          |                         |          | 769,018,498.48           |
| 买入返售金融资产               |                          | 418,969,973.75        | 472,505,053.26          | 3,603,787,337.33         | 2,751,076,727.91        |          | 7,246,339,092.25         |
| 存出保证金                  |                          | 37,595,509.06         |                         |                          |                         |          | 37,595,509.06            |
| 可供出售金融资产               | 3,800,644,583.31         | 150,999,325.27        | 577,840,170.03          | 3,892,904,887.14         | 1,102,719,000.00        | -        | 9,525,107,965.75         |
| <b>合 计</b>             | <b>20,449,740,552.19</b> | <b>954,682,867.89</b> | <b>3,001,018,880.45</b> | <b>16,320,036,100.66</b> | <b>3,853,795,727.91</b> | <b>-</b> | <b>44,579,274,129.10</b> |

(续上表)

| 项 目                    | 期初余额              |                  |                  |                  |                  |       |                   |
|------------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------|-------------------|
|                        | 即期                | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年         | 1-5 年            | 5 年以上 | 合计                |
| 货币资金                   | 12,898,376,276.10 | 1,800,000,000.00 | —                | —                | —                | —     | 14,698,376,276.10 |
| 结算备付金                  | 2,338,295,532.96  | —                | —                | —                | —                | —     | 2,338,295,532.96  |
| 融出资金                   | —                 | 3,254,394,654.11 | 2,702,438,720.52 | 4,646,272,395.81 | —                | —     | 10,603,105,770.44 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 676,426,542.98    | —                | —                | —                | —                | —     | 676,426,542.98    |
| 买入返售金融资产               | —                 | 486,543,994.58   | 320,937,135.75   | 1,784,668,013.53 | 3,313,844,618.24 | —     | 5,905,993,762.10  |
| 存出保证金                  | —                 | 66,126,979.43    | —                | —                | —                | —     | 66,126,979.43     |

|            |                          |                         |                         |                         |                         |                       |                          |
|------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 可供出售金融资产   | 7,384,445,231.65         | 14,520,592.18           | 116,645,845.95          | 655,855,325.17          | 3,014,794,383.45        | 301,437,495.23        | 11,487,698,873.63        |
| <b>合 计</b> | <b>23,297,543,583.69</b> | <b>5,621,586,220.30</b> | <b>3,140,021,702.22</b> | <b>7,086,795,734.51</b> | <b>6,328,639,001.69</b> | <b>301,437,495.23</b> | <b>45,776,023,737.64</b> |

母公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

| 项 目        | 期末余额                     |                         |                         |                         |                         |          |                          |
|------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------|--------------------------|
|            | 即期                       | 1 个月以内                  | 1-3 个月                  | 3 个月-1 年                | 1-5 年                   | 5 年以上    | 合计                       |
| 应付短期融资款    |                          | 134,170,000.00          | 5,073,780,000.00        | 4,182,154,257.98        |                         |          | 9,390,104,257.98         |
| 卖出回购金融资产款  |                          | 1,826,053,229.00        | 6,078,998.50            |                         | 1,500,000,000.00        |          | 3,332,132,227.50         |
| 代理买卖证券款    | 12,466,458,109.61        |                         |                         |                         |                         |          | 12,466,458,109.61        |
| 应付债券       |                          |                         |                         |                         | 7,017,186,506.05        |          | 7,017,186,506.05         |
| <b>合 计</b> | <b>12,466,458,109.61</b> | <b>1,960,223,229.00</b> | <b>5,079,858,998.50</b> | <b>4,182,154,257.98</b> | <b>8,517,186,506.05</b> | <b>-</b> | <b>32,205,881,101.14</b> |

(续上表)

| 项 目        | 期初余额                     |                         |                         |                         |                         |          |                          |
|------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------|--------------------------|
|            | 即期                       | 1 个月以内                  | 1-3 个月                  | 3 个月-1 年                | 1-5 年                   | 5 年以上    | 合计                       |
| 应付短期融资款    | —                        | 61,480,000.00           | 1,605,910,000.00        | 6,050,000,000.00        | —                       | —        | 7,717,390,000.00         |
| 卖出回购金融资产款  | —                        | 1,193,642,080.00        | 11,668,000.00           | 910,000,000.00          | 500,000,000.00          | —        | 2,615,310,080.00         |
| 代理买卖证券款    | 13,402,899,714.10        | —                       | —                       | —                       | —                       | —        | 13,402,899,714.10        |
| 应付债券       | —                        | —                       | —                       | —                       | 9,492,261,596.14        | —        | 9,492,261,596.14         |
| <b>合 计</b> | <b>13,402,899,714.10</b> | <b>1,255,122,080.00</b> | <b>1,617,578,000.00</b> | <b>6,960,000,000.00</b> | <b>9,992,261,596.14</b> | <b>—</b> | <b>33,227,861,390.24</b> |

(1) 本公司面临的流动性风险及其具体表现

本公司在业务经营中，可能因业务规模大幅上升、履行大额表外担保和承诺、不能按计划完成外部融资、系统故障、人为操作失误等情形，造成公司流动性风险监管指标低于监管标准，或无法偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求。若外部市场发生重大变化，如融资市场紧缩、证券市场剧烈波动等可能导致公司出现金融资产无法及时通过合理价格变现来满足流动性要求。

如流动性风险监管指标（流动性覆盖率、净稳定资金率）低于监管标准，或发生重大流动性风险事件，则公司可能受到监管部门的处罚，对公司的业务资格、经营管理及公司声誉造成严重不利影响。

期末，本公司持有的货币资金、结算备付金合计人民币 198.52 亿元，货币基金、国债等优质金融资产合计人民币 6.47 亿元，迅速变现的能力强，能于到期日应付可预见的融资承诺或资金被客户提取的需求。因此，本公司认为面临的流动性风险不重大。

(2) 对流动性风险进行管理

公司严格按照证监会、证券业协会的要求，认真落实流动性风险管控措施、监控公司流动性状况变化、有效监控、防范和化解流动性风险，并通过拓宽多元化融资渠道、优化融资结构、调整业务结构、控制业务节奏等措施，持续优化和改善公司流动性状况。主要应对措施包括：

①严格监控流动性风险监管指标，确保指标持续达标。加强对流动性风险监管指标的主动管理，如发现指标出现较大不利变化，及时进行融资，补充长短期资金，调整融资结构，同时向有关业务用资部门提出减缓用资节奏、控制业务规模等要求，以保证流动性风险监管指标的持续达标。

②强化资金计划管理、全面监控流动性风险状况。公司每月根据业务资金需求、债务还本付息、流动性指标状况，结合对市场的预期制订相应的资金计划；注重对流动性风险状况的常规分析和预测，提前做好应对措施，调整资金计划，落实融资安排，控制业务节奏，以缓解流动性压力，确保公司流动性风险监管指标持续符合监管要求；

③认真开展流动性风险压力测试工作。按照证券业协会要求定期对公司整体流动性状况进行综合压力测试，并针对重要的业务操作和经营行为不定期进行专项压力测试，认真开展流动性风险应急演练，明确流动性风险管理工作的重点和关键节，落实相应的管控措施，

确保相关业务和行为不会对公司流动性状况产生严重不利影响；

④建立和完善流动性风险管理系统，提高流动性风险管理的信息化水平；

⑤将流动性风险因素纳入公司部门绩效考核体系，强化各流动性相关部门的责任。

### 5、金融资产的转移

在日常业务中，本公司部分交易将已确认的金融资产转让给第三方或客户，但本公司尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本公司通过质押或转让以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产、融出资金收益权交予交易对手取得款项，并与其签订回购上述资产的协议。根据协议，交易对手拥有收取上述证券协议期间合同现金流和再次将上述证券或收益权用于担保的权利，同时承担在协议规定的到期日将上述证券和收益权归还本公司的义务。本公司认为上述融资资产的风险与回报均未转移，因此并未于资产负债表终止确认上述金融资产。另外，本公司与客户订立协议，融出可供出售金融资产予客户，以客户的证券或押金为抵押，由于本公司仍保留有关证券的全部风险，因此并未于资产负债表终止确认该等证券。

已转让但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

| 项 目        | 期末余额                    |                       |                  |                         |
|------------|-------------------------|-----------------------|------------------|-------------------------|
|            | 债券                      | 融资融券收益权               | 交易所股票质押<br>债权收益权 | 合计                      |
| 转让资产的账面价值  | 9,024,649,865.84        | 1,731,131,610.65      |                  | 10,755,781,476.49       |
| 相关负债的账面值   | 4,487,430,227.50        | 1,500,000,000.00      |                  | 5,987,430,227.50        |
| <b>净头寸</b> | <b>4,537,219,638.34</b> | <b>231,131,610.65</b> |                  | <b>4,768,351,248.99</b> |

(续上表)

| 项 目        | 期初余额                    |                       |                  |                         |
|------------|-------------------------|-----------------------|------------------|-------------------------|
|            | 债券                      | 融资融券收益权               | 交易所股票质<br>押债权收益权 | 合计                      |
| 转让资产的账面价值  | 5,391,576,604.49        | 1,735,821,244.55      | —                | 7,127,397,849.04        |
| 相关负债的账面值   | 2,875,290,080.00        | 1,410,000,000.00      | —                | 4,285,290,080.00        |
| <b>净头寸</b> | <b>2,516,286,524.49</b> | <b>325,821,244.55</b> | —                | <b>2,842,107,769.04</b> |

期末在融资融券、约定购回、股票质押等信用业务中借出资券及抵押物如下：

| 项 目 | 期末余额 |
|-----|------|
|-----|------|

|           | 融出资金              | 融出证券           | 约定购回           | 股票质押              |
|-----------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| 借出资券的账面余额 | 13,355,762,256.41 | 32,155,863.45  | 297,609,764.73 | 6,631,924,461.74  |
| 收取担保物的市值  | 34,281,821,432.23 | 138,181,242.90 | 505,337,566.76 | 15,013,229,123.12 |

(续上表)

| 项 目       | 期初余额              |                |                  |                   |
|-----------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|
|           | 融出资金              | 融出证券           | 约定购回             | 股票质押              |
| 借出资券的账面余额 | 12,280,892,474.05 | 69,480,537.94  | 749,443,236.68   | 5,074,481,649.28  |
| 收取担保物的市值  | 38,605,112,777.57 | 213,129,971.38 | 1,646,458,961.89 | 15,142,977,020.54 |

## 九、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

| 项 目                          | 期末公允价值                   |                       |                |                          |
|------------------------------|--------------------------|-----------------------|----------------|--------------------------|
|                              | 第一层次公允价值<br>计量           | 第二层次公允价值<br>计量        | 第三层次公允价值<br>计量 | 合计                       |
| <b>一、持续的公允价值计量</b>           |                          |                       |                |                          |
| (一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产    | <b>1,290,128,720.17</b>  | —                     | —              | <b>1,290,128,720.17</b>  |
| (1) 债务工具投资                   | 189,676,619.44           | —                     | —              | 189,676,619.44           |
| (2) 权益工具投资                   | 1,100,452,100.73         | —                     | —              | 1,100,452,100.73         |
| (二) 可供出售金融资产                 | <b>22,773,334,677.03</b> | <b>543,051,800.00</b> | —              | <b>23,316,386,477.03</b> |
| (1) 债务工具投资                   | 20,828,047,702.44        | —                     | —              | 20,828,047,702.44        |
| (2) 权益工具投资                   | 1,945,286,974.59         | 543,051,800.00        | —              | 2,488,338,774.59         |
| <b>持续以公允价值计量的资产总额</b>        | <b>24,063,463,397.20</b> | <b>543,051,800.00</b> | <b>0.00</b>    | <b>24,606,515,197.20</b> |
| (三) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债    | <b>11,372,270,008.52</b> | —                     | —              | <b>11,372,270,008.52</b> |
| 1. 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 | 11,372,270,008.52        | —                     | —              | 11,372,270,008.52        |
| <b>持续以公允价值计量的负债总额</b>        | <b>11,372,270,008.52</b> | —                     | —              | <b>11,372,270,008.52</b> |
| <b>二、非持续的公允价值计量</b>          |                          |                       |                |                          |
| 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              | —                        | —                     | —              | —                        |

持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据：在资产负债表日取得的相同资产或负

债在活跃市场上未经调整的报价。

2、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

| 项 目                | 期末公允价值         | 估值技术 | 输入值 |
|--------------------|----------------|------|-----|
| 按公允价值计量的其他可供出售权益工具 | 543,051,800.00 | 市净率法 | 市净率 |

## 十、关联方及关联交易

### 1、本公司的母公司情况

| 母公司名称            | 关联关系 | 企业类型   | 注册地 | 法定代表人 | 业务性质   | 注册资本  | 母公司对本公司的持股比例(%) | 对本公司的表决权比例(%) | 本公司最终控制方 | 统一社会信用代码           |
|------------------|------|--------|-----|-------|--------|-------|-----------------|---------------|----------|--------------------|
| 安徽国元控股(集团)有限责任公司 | 母公司  | 有限责任公司 | 合肥  | 张子良   | 国有资产管理 | 30 亿元 | 37.46           | 37.46         | 安徽省国资委   | 91340000719961611L |

注：安徽国元控股(集团)有限责任公司对本公司直接持股 21.99%，通过子公司安徽国元信托有限责任公司间接持股 15.47%，合计持股 37.46%。

### 2、本公司的子公司情况

| 子公司全称             | 子公司类型 | 企业类型 | 注册地 | 法定代表人 | 业务性质                      | 注册资本           | 持股比例(%) | 表决权比例(%) | 统一社会信用代码             |
|-------------------|-------|------|-----|-------|---------------------------|----------------|---------|----------|----------------------|
| 国元证券(香港)有限公司      | 全资子公司 | 有限公司 | 香港  | 王尔宏   | 证券经纪、自营业务、香港证券监管机构许可的其他业务 | 10 亿港元         | 100.00  | 100.00   | 37022318-000-07-07-5 |
| 国元股权投资有限公司        | 全资子公司 | 有限公司 | 上海  | 陈家元   | 投资业务                      | 10 亿人民币        | 100.00  | 100.00   | 913100006929662273   |
| 国元期货有限公司          | 控股子公司 | 有限公司 | 北京  | 洪明    | 资产管理，商品期货经纪。              | 60,969.46 万人民币 | 98.41   | 98.41    | 91110000710924099Q   |
| 国元创新投资有限公司        | 全资子公司 | 有限公司 | 合肥  | 黄显峰   | 投资业务                      | 15 亿人民币        | 100.00  | 100.00   | 340100000723377      |
| 安徽省股权托管交易中心有限责任公司 | 控股子公司 | 有限公司 | 合肥  | 陈益民   | 股权登记托管业务                  | 2 亿人民币         | 50.00   | 50.00    | 91340000075608854X   |

### 3、本公司的联营企业情况

| 被投资单位名称 | 企业类型 | 注册地 | 法定代表人 | 业务性质 | 注册资本 | 本企业持股比例(%) | 本企业在被投资单位表决权比例(%) | 关联关系 | 统一社会信用代码 |
|---------|------|-----|-------|------|------|------------|-------------------|------|----------|
|---------|------|-----|-------|------|------|------------|-------------------|------|----------|



|                             |      |    |     |                      |                 |       |       |      |                        |
|-----------------------------|------|----|-----|----------------------|-----------------|-------|-------|------|------------------------|
| 长盛基金管理有限公司                  | 有限公司 | 深圳 | 周兵  | 基金管理业务;发起<br>设立基金    | 1.89 亿 人 民<br>币 | 41.00 | 41.00 | 参股企业 | 914403007109<br>24152L |
| 安徽安元投资基金有限公司                | 有限公司 | 合肥 | 蔡咏  | 股权投资、基金投<br>资、投资顾问等  | 30 亿人民币         | 43.33 | 43.33 | 参股企业 | 913401003487<br>227680 |
| 安徽安元投资基金管理有限<br>公司          | 有限公司 | 合肥 | 刘振  | 受托管理股权投资<br>基金、投资顾问等 | 5,000 万人民<br>币  | 30.00 | 30.00 | 参股企业 | 913401003364<br>2064XL |
| 合肥中电科国元产业投资基<br>金合伙企业（有限合伙） | 有限合伙 | 合肥 | 不适用 | 股权投资、投资管理<br>及投资咨询   | 不适用             | 21.90 | 21.90 | 参股企业 | 91340111MA<br>2MXMGR37 |

#### 4、本公司的其他关联方情况

| 其他关联方名称        | 其他关联方与本公司的关系         | 统一社会信用代码           |
|----------------|----------------------|--------------------|
| 安徽国元信托有限责任公司   | 持股 5%以上股东            | 91340000758510848J |
| 安徽省粮油进出口（集团）公司 | 持股 5%以上股东            | 91340000148940226K |
| 国元农业保险股份有限公司   | 国元集团的子公司             | 91340000MA2N01CQ3X |
| 安粮期货股份有限公司     | 安徽省粮油进出口（集团）公司的控股子公司 | 91340000100023365F |

#### 5、关联交易情况

##### (1) 代理销售金融产品手续费及佣金收入情况

| 关联方          | 关联交易内容   | 关联交易定价方式及决策程序 | 本期发生额    |            | 上期发生额  |            |
|--------------|----------|---------------|----------|------------|--------|------------|
|              |          |               | 金额       | 占同类交易比例(%) | 金额     | 占同类交易比例(%) |
| 长盛基金管理有限公司   | 代理销售金融产品 | 按照市场价格进行      | —        | —          | 347.29 | 0.01       |
| 国元农业保险股份有限公司 | 代理销售金融产品 | 按照市场价格进行      | 5,407.24 | 0.55       | —      | —          |
| <b>合计</b>    |          |               | 5,407.24 | 0.55       | 347.29 | 0.01       |

##### (2) 交易单元席位出租手续费及佣金收入情况

| 关联方        | 关联交易内容       | 关联交易定价方式及决策程序 | 本期发生额 |            | 上期发生额      |            |
|------------|--------------|---------------|-------|------------|------------|------------|
|            |              |               | 金额    | 占同类交易比例(%) | 金额         | 占同类交易比例(%) |
| 长盛基金管理有限公司 | 出租交易席位取得租赁收入 | 按照市场价格进行      | —     | —          | 242,189.35 | 5.20       |

##### (3) 房屋租赁收入情况

| 关联方          | 关联交易内容 | 关联交易定价方式及决策程序 | 本期发生额             |             | 上期发生额      |            |
|--------------|--------|---------------|-------------------|-------------|------------|------------|
|              |        |               | 金额                | 占同类交易比例(%)  | 金额         | 占同类交易比例(%) |
| 安粮期货有限公司     | 房屋出租   | 按照市场价格进行      | 487,926.86        | 8.07        | 487,926.86 | 9.55       |
| 国元农业保险股份有限公司 | 房屋出租   | 按照市场价格进行      | —                 | —           | 58,243.20  | 1.14       |
| <b>合计</b>    |        |               | <b>487,926.86</b> | <b>8.07</b> | 546,170.06 | 10.69      |

##### (4) 公司认（申）购、赎回安徽国元信托有限责任公司产品情况

| 产品品种                              | 年初金额                  | 本期增加        | 本期减少                 | 期末金额                  | 计入损益的金额<br>(亏损以“-”表示) |
|-----------------------------------|-----------------------|-------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 国元信托安盈 201506001 (镇江交投) 集合资金信托计划  | 20,000,000.00         |             |                      | 20,000,000.00         | 889,589.04            |
| 国元信托安盈 201605001 (兖州旅游) 集合信托计划    | 20,000,000.00         |             | 20,000,000.00        | -                     | 356,712.33            |
| 国元信托安丰 201606001 号 (金堂农投) 集合资金信托计 | 20,000,000.00         |             |                      | 20,000,000.00         | 837,093.61            |
| 国元信托安盈 20165003 (青州城投) 集合信托计划     | 30,000,000.00         |             |                      | 30,000,000.00         | 1,262,465.76          |
| 国元信托 (天业股份) 贷款集合信托计划              | 20,000,000.00         |             | 20,000,000.00        | -                     | 1,400,383.56          |
| 国元证券*安盈 201608002 号 (攸州集团) 集合信托计划 | 25,000,000.00         |             |                      | 25,000,000.00         | 996,164.38            |
| 国元信托安盈 201604001 号 (句容农发) 集合信托计划  | 20,000,000.00         |             |                      | 20,000,000.00         | 683,643.83            |
| 国元信托安盈 201603006 (云南国资) 集合信托计划    | 20,000,000.00         |             |                      | 20,000,000.00         | 734,027.40            |
| 国元信托安丰 201507001 集合资金信托计划         | 30,000,000.00         |             |                      | 30,000,000.00         | 1,402,315.07          |
| 国元信托安丰 201506001 盐城盐都集合资金信托计划     | 30,000,000.00         |             |                      | 30,000,000.00         | 1,381,479.46          |
| 国元信托安丰 201502007 镇江瀚瑞集合资金项目       | 20,000,000.00         |             |                      | 20,000,000.00         | 980,986.30            |
| <b>合 计</b>                        | <b>255,000,000.00</b> | <b>0.00</b> | <b>40,000,000.00</b> | <b>215,000,000.00</b> | <b>10,924,860.74</b>  |

## 十一、或有事项

### 未决诉讼

(1) 方梅莲诉任海东、国元证券杭州密渡桥路证券营业部证券交易纠纷案件情况如下：2014 年 9 月，方梅莲诉至宁波市象山县人民法院，将任海东列为第一被告，国元证券杭州密渡桥路证券营业部列为第二被告，称第一被告诱使其在被告二开立股票及资金账户，第一被告及第二被告未对其进行通知情况下擅自为其开通创业板，且第二被告未对其尽到投资者教育义务，现第一被告操作方梅莲股票账户致使其损失 14,651,882.79 元，方梅莲要求第一被告，第二被告对其损失承担连带赔偿责任。我司提出管辖权异议，宁波市象山县人民法院同意我司管辖区异议并作出裁定，方梅莲就该裁定提出上诉，宁波市中院驳回方梅莲上诉，维持原裁定。2015 年 9 月 25 日，浙江省高级人民法院就方梅莲诉任海东、国元证券杭州密渡桥路证券营业部证券交易纠纷案件作出指定管辖民事裁定，认定本案为侵权责任纠纷，撤销象山县人民法院及宁波中级人民法院的民事裁定，裁定由象山县人民法院管辖。目前象山县人民法院已于 2017 年 3 月 31 日开庭审理本案，并通知 2017 年 7 月 19 日第二次开庭审理。本公司针对该案件计提 2,930,376.55 元预计负债。

(2) 李映东诉公司证券期货交易纠纷案件情况如下：2016年9月19日，公司收到广州仲裁委员会送达的李映东诉公司证券期货交易纠纷仲裁申请书、证据材料等，申请人李映东认为公司强制平仓错误，要求公司赔偿损失、律师费和仲裁费等，合计金额约26,617,120.00元。2016年9月30日，公司向广州仲裁委员会递交了证据材料等。2016年11月3日，本案在广州仲裁委员会开庭审理，截止2017年6月30日，广州仲裁委员会尚未裁决。本公司针对该案件计提2,661,712.00元预计负债。

(3) 黄洪波诉张鹏、张亚宁、珠海金湾南翔路证券营业部民间借贷纠纷案件情况如下：2016年11月15日，公司收到珠海金湾南翔路证券营业部报送的黄洪波起诉张鹏、张亚宁、珠海金湾南翔路证券营业部民间借贷纠纷起诉状、证据材料、传票等诉讼文件，原告黄洪波妻子张月琴系该营业部客户，被告张鹏原系该营业部营销经理后转为经纪人（现已解除委托关系），原告与被告张鹏因借款合同发生纠纷，要求张鹏偿还借款本金240万元及利息，并要求营业部承担相应责任。本案营业部申请管辖权异议，法院裁定异议成立，本案移送至珠海市金湾区人民法院审理，2017年5月开庭审理，目前尚未判决。对该案件本公司预计不会产生损失。

(4) “绿润债”债券回购合同纠纷案件情况如下：2016年4月13日，公司作为浦江1号、元赢4号集合资管计划管理人，向合肥市蜀山区人民法院提起诉讼，诉请北京绿润食品有限公司（以下简称“绿润公司”）支付债券本金1,240万元及自2015年8月29日起按年利率12%至款清日利息，北京密云经济开发区总公司、莒南县鸿润食品有限公司、陈思、刘丽华、陈星承担连带担保责任。本案已于2016年7月26日、2016年9月8日和2016年10月24日三次在合肥市蜀山区人民法院开庭审理。2016年10月25日，公司收到法院一审判决书，判决被告北京绿润食品有限公司支付公司债券本金1,235万元及自2015年8月29日至款清日按年利率10%的逾期利息，北京密云经济开发区总公司承担连带清偿责任。2016年12月26日，公司向法院申请强制执行，目前对方仍未履行判决，案件正在执行阶段。对该案件本公司不会产生损失。

## 十二、承若事项

本公司无需要披露的前期承诺事项。

## 十三、资产负债表日后事项

### 公司非公开发行 A 股股票情况

根据公司2016年第一次临时股东大会决议，公司非公开发行A股股票决议的有效期

限为 2016 年第一次临时股东大会审议通过之日起 12 个月，即 2017 年 7 月 27 日到期。为保持本次非公开发行 A 股股票工作的延续性和有效性，确保本次发行有关事宜的顺利进行，公司 2017 年第二次临时股东大会同意将本次非公开发行股票决议的有效期限自届满之日起延长 12 个月。

#### 十四、其他重要事项说明

##### 1、分部信息

###### (1) 报告分部的确定依据与会计政策

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，以经营分部为基础确定报告分部，并披露分部信息。

经营分部是指本公司内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本公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其分配资源、评价其业绩；
- ③本公司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。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件，本公司将其合并为一个经营分部。

本公司报告分部包括：证券经纪业务、期货经纪业务、证券自营业务、投资银行业务、资产管理业务、信用交易业务、公司总部及其他。

本公司经营分部的会计政策与本公司主要会计政策相同。

## (2) 报告分部的财务信息

| 项 目       | 2017 年度 1-6 月     |                |                  |                   |                   |                  |                   |         |                   |
|-----------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|---------|-------------------|
|           | 经纪业务              | 投行业务           | 自营投资业务           | 资产管理业务            | 证券信用业务            | 境外子公司            | 其他                | 分部间相互抵减 | 合计                |
| 一、营业收入    | 466,569,237.63    | 182,569,611.39 | 342,720,224.71   | 50,870,096.03     | 311,372,826.52    | 105,081,858.83   | 112,428,162.21    | —       | 1,571,612,017.32  |
| 手续费及佣金净收入 | 351,159,895.97    | 182,569,611.39 | -                | 50,870,096.03     | -                 | 30,146,598.49    | -27,404,057.48    | —       | 587,342,144.40    |
| 其他收入      | 115,409,341.66    | -              | 342,720,224.71   | -                 | 311,372,826.52    | 74,935,260.34    | 139,832,219.69    | —       | 984,269,872.92    |
| 二、营业支出    | 305,914,048.97    | 95,806,818.61  | 8,090,825.19     | 24,132,188.42     | 21,193,589.00     | 52,789,938.56    | 393,052,013.38    | —       | 900,979,422.13    |
| 三、营业利润    | 160,655,188.66    | 86,762,792.78  | 334,629,399.52   | 26,737,907.61     | 290,179,237.52    | 52,291,920.27    | -280,623,851.17   | —       | 670,632,595.19    |
| 四、资产总额    | 14,332,622,598.72 | -              | 7,484,814,610.31 | 14,209,209,920.27 | 18,496,372,979.97 | 4,642,942,335.59 | 13,827,200,485.80 | —       | 72,993,162,930.66 |
| 五、负债总额    | 13,490,018,642.74 | -              | 1,832,154,263.76 | 14,209,209,920.27 | -                 | 3,415,118,048.59 | 19,320,124,955.90 | —       | 52,266,625,831.26 |
| 六、补充信息    |                   |                |                  |                   |                   |                  |                   |         | -                 |
| 1、利息收入    | 110,970,851.40    | -              | 9,662,199.35     | -                 | 599,966,626.52    | 65,511,934.66    | 187,701,525.69    | —       | 973,813,137.62    |
| 2、利息支出    | 20,792,570.22     | -              | 21,108,968.16    | -                 | 288,593,800.00    | 12,774,937.37    | 177,563,254.13    | —       | 520,833,529.88    |
| 3、折旧和摊销费用 | 11,805,665.22     | 399,114.48     | 16,628.38        | 61,836.61         | 49,702.45         | 2,224,203.66     | 45,199,275.04     | —       | 59,756,425.84     |
| 4、资产减值损失  | -                 | -              | -22,911,274.81   | -                 | 14,300,480.35     | -                | -2,890,564.85     | —       | -11,501,359.31    |
| 5、资本性支出   | 6,983,828.47      | -              | -                | -                 | -                 | 1,731,921.84     | 36,112,150.16     | —       | 44,827,900.47     |

(续上表)

| 项 目       | 2016 年度 1-6 月     |                |                  |                  |                   |                  |                   |         |                   |
|-----------|-------------------|----------------|------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|---------|-------------------|
|           | 经纪业务              | 投行业务           | 自营投资业务           | 资产管理业务           | 证券信用业务            | 境外子公司            | 其他                | 分部间相互抵减 | 合计                |
| 一、营业收入    | 648,198,825.35    | 178,063,281.46 | 123,389,383.74   | 24,613,249.12    | 374,895,993.57    | 66,226,302.06    | -12,559,792.99    |         | 1,402,827,242.31  |
| 手续费及佣金净收入 | 503,505,923.09    | 178,063,281.46 | -                | 24,613,249.12    | -                 | 24,778,271.57    | -7,750,520.05     |         | 723,210,205.19    |
| 其他收入      | 144,692,902.26    | -              | 123,389,383.74   | -                | 374,895,993.57    | 41,448,030.49    | -4,809,272.94     |         | 679,617,037.12    |
| 二、营业支出    | 305,986,919.41    | 77,511,857.92  | 9,037,709.99     | 40,269,890.34    | 24,828,967.54     | 38,091,975.81    | 305,269,869.84    |         | 800,997,190.85    |
| 三、营业利润    | 342,211,905.94    | 100,551,423.54 | 114,351,673.75   | -15,656,641.22   | 350,067,026.03    | 28,134,326.25    | -317,829,662.83   | -       | 601,830,051.46    |
| 四、资产总额    | 19,367,906,652.91 | -              | 5,988,898,163.85 | 8,265,166,761.24 | 15,245,726,603.60 | 4,291,332,094.41 | 14,084,357,342.93 |         | 67,243,387,618.94 |
| 五、负债总额    | 18,554,445,764.11 | -              | 999,300,368.57   | 8,265,166,761.24 | 372,318,433.75    | 3,160,991,651.98 | 16,159,313,884.70 |         | 47,511,536,864.35 |
| 六、补充信息    |                   |                |                  |                  |                   |                  |                   |         | -                 |
| 1、利息收入    | 163,190,454.73    | -              | 6,432,086.91     | -                | 617,748,993.57    | 45,809,634.40    | 54,047,535.64     |         | 887,228,705.25    |
| 2、利息支出    | 28,457,244.79     | -              | 7,940,872.38     | -                | 242,853,000.00    | 7,429,924.99     | 222,147,111.75    |         | 508,828,153.91    |
| 3、折旧和摊销费用 | 18,805,512.42     | 356,046.04     | 13,594.48        | 64,412.54        | 48,337.59         | 2,188,369.71     | 43,168,804.00     |         | 64,645,076.78     |
| 4、资产减值损失  | 63,590.18         |                |                  |                  | -15,323,006.39    | -                | 2,089,445.64      |         | -13,169,970.57    |
| 5、资本性支出   | 6,171,609.47      |                |                  |                  |                   | 1,577,136.84     | 39,261,819.00     |         | 47,010,565.31     |

## 2、融资融券业务

| 项 目        | 期末余额                     |
|------------|--------------------------|
| 融出资金       | 13,355,762,256.41        |
| 融券业务       | 32,155,863.45            |
| <b>合 计</b> | <b>13,387,918,119.86</b> |

注：融出资金详见本附注五、3；融券业务详见本附注五、11。

## 3、社会责任

2017年1-6月份公司在慈善捐助等公益性方面的投入金额共计520.00万元，具体如下：

| 被捐赠单位       | 捐赠金额                |
|-------------|---------------------|
| 安徽省寿县扶贫开发协会 | 1,000,000.00        |
| 安徽省残疾人福利基金会 | 200,000.00          |
| 太湖县扶贫开发办公室  | 4,000,000.00        |
| <b>合 计</b>  | <b>5,200,000.00</b> |

## 十五、母公司财务报表主要项目注释

### 1、长期股权投资

#### (1) 按类别列示

| 项 目        | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| 子公司        | 4,191,719,495.33        | 4,191,719,495.33        |
| 联营企业       | 1,817,715,343.81        | 1,795,188,577.20        |
| 小计         | 6,009,434,839.14        | 5,986,908,072.53        |
| 减：减值准备     | —                       | —                       |
| <b>合 计</b> | <b>6,009,434,839.14</b> | <b>5,986,908,072.53</b> |

#### (2) 长期股权投资明细情况



| 被投资单位             | 核算方法 | 投资成本                    | 期初余额                    | 增减变动                 | 其中：联营及合营企业其他综合收益变动中享有的份额 | 期末余额                    | 在被投资单位持股比例(%) | 在被投资单位表决权比例(%) | 在被投资单位持股比例与表决权比例不一致的说明 | 减值准备 | 本期计提减值准备 | 本期现金红利                |
|-------------------|------|-------------------------|-------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------|---------------|----------------|------------------------|------|----------|-----------------------|
| 联营企业：             |      |                         |                         |                      |                          |                         |               |                |                        |      |          |                       |
| 长盛基金管理有限公司        | 权益法  | 119,269,218.56          | 461,909,305.00          | 16,427,960.70        | 4,094,234.32             | 478,337,265.70          | 41            | 41             |                        | —    | —        | 18,860,000.00         |
| 安徽安元投资基金有限公司      | 权益法  | 1,300,000,000.00        | 1,314,360,406.26        | 1,651,677.91         | 72.08                    | 1,316,012,084.17        | 43.33         | 43.33          |                        | —    | —        |                       |
| 安徽安元投资基金管理有限公司    | 权益法  | 15,000,000.00           | 18,918,865.94           | 4,447,128.00         | —                        | 23,365,993.94           | 30            | 30             |                        | —    | —        |                       |
| <b>权益法小计</b>      |      | <b>1,434,269,218.56</b> | <b>1,795,188,577.20</b> | <b>22,526,766.61</b> | <b>4,094,306.40</b>      | <b>1,817,715,343.81</b> |               |                |                        | —    | —        | 18,860,000.00         |
| 子公司：              |      |                         |                         |                      |                          |                         |               |                |                        |      |          |                       |
| 国元证券（香港）有限公司      | 成本法  | 855,688,500.00          | 855,688,500.00          | —                    | —                        | 855,688,500.00          | 100           | 100            |                        | —    | —        |                       |
| 国元期货有限公司          | 成本法  | 717,823,995.33          | 717,823,995.33          | —                    | —                        | 717,823,995.33          | 98.41         | 98.41          |                        | —    | —        |                       |
| 国元股权投资有限公司        | 成本法  | 1,000,000,000.00        | 1,000,000,000.00        | —                    | —                        | 1,000,000,000.00        | 100           | 100            |                        | —    | —        | 120,000,000.00        |
| 国元创新投资有限公司        | 成本法  | 1,500,000,000.00        | 1,500,000,000.00        | —                    | —                        | 1,500,000,000.00        | 100           | 100            |                        | —    | —        | 80,000,000.00         |
| 安徽省股权托管交易中心有限责任公司 | 成本法  | 118,207,000.00          | 118,207,000.00          | —                    | —                        | 118,207,000.00          | 50            | 50             |                        | —    | —        | 10,000,000.00         |
| <b>成本法小计</b>      |      | <b>4,191,719,495.33</b> | <b>4,191,719,495.33</b> | —                    | —                        | <b>4,191,719,495.33</b> |               |                |                        | —    | —        | <b>210,000,000.00</b> |
| <b>合计</b>         |      | <b>5,625,988,713.89</b> | <b>5,986,908,072.53</b> | <b>22,526,766.61</b> | <b>4,094,306.40</b>      | <b>6,009,434,839.14</b> |               |                |                        | —    | —        | <b>228,860,000.00</b> |

## 2、手续费及佣金净收入

手续费及佣金净收入按类别列示

| 项 目             | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-----------------|----------------|----------------|
| <b>手续费及佣金收入</b> | 698,302,441.77 | 781,665,033.32 |
| 1.经纪业务收入        | 454,195,211.13 | 568,939,942.75 |
| 其中：证券经纪业务收入     | 454,195,211.13 | 568,939,942.75 |
| 其中：代理买卖证券业务     | 451,179,873.35 | 560,804,024.90 |
| 交易单元席位租赁        | 2,028,540.97   | 4,654,343.59   |
| 代销金融产品业务        | 986,796.76     | 3,481,574.26   |
| 期货经纪业务收入        | —              | —              |
| 2.投资银行业务收入      | 191,320,235.33 | 182,365,324.23 |
| 其中：证券承销业务       | 145,275,471.69 | 125,112,879.40 |
| 证券保荐业务          | 6,037,735.85   | 11,430,188.68  |
| 财务顾问业务          | 40,007,027.79  | 45,822,256.15  |
| 3.投资咨询业务收入      | 2,104,962.61   | 5,959,844.80   |
| 4.资产管理业务收入      | 50,634,361.55  | 24,399,275.83  |
| 5.其 他           | 47,671.15      | 645.71         |
| <b>手续费及佣金支出</b> | 137,867,162.48 | 90,099,385.92  |
| 1.经纪业务支出        | 129,116,208.96 | 85,783,005.70  |
| 其中：证券经纪业务支出     | 129,116,208.96 | 85,783,005.70  |
| 其中：代理买卖证券业务     | 129,113,933.96 | 85,767,995.78  |
| 交易单元席位租赁        | —              | —              |
| 代销金融产品业务        | —              | 210.92         |
| 期货经纪业务支出        | —              | —              |
| 2.投资银行业务支出      | 8,750,623.94   | 4,302,042.77   |
| 其中：证券承销业务       | 8,750,623.94   | 4,302,042.77   |

|                         |                       |                       |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 证券保荐业务                  | —                     |                       |
| 财务顾问业务                  | —                     |                       |
| 3.投资咨询业务支出              | —                     |                       |
| 4.资产管理业务支出              | —                     | 14,337.45             |
| 5.其他                    | 329.58                | 0.00                  |
| <b>手续费及佣金净收入</b>        | <b>560,435,279.29</b> | <b>691,565,647.40</b> |
| 其中：财务顾问业务净收入            | 40,007,027.79         | 45,822,256.15         |
| ——并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司 | 13,867,924.53         | 5,000,000.00          |
| ——并购重组财务顾问业务净收入——其他     | —                     |                       |
| ——其他财务顾问业务净收入           | 26,139,103.26         | 40,822,256.15         |

### 3、投资收益

#### (1) 投资收益明细情况

| 项 目                      | 本期发生额          | 上期发生额          |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 成本法核算的长期股权投资收益           | 10,000,000.00  | —              |
| 权益法核算的长期股权投资收益           | 37,292,460.21  | 30,316,360.23  |
| 金融工具投资收益                 | 287,320,634.32 | 164,076,474.66 |
| 其中：持有期间取得的收益             | 164,509,297.22 | 29,726,257.33  |
| ——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 6,160,607.52   | 1,586,160.00   |
| ——持有至到期投资                | —              | —              |
| ——可供出售金融资产               | 158,348,689.70 | 28,140,097.33  |
| ——衍生金融工具                 | —              | —              |
| 处置金融工具取得的收益              | 122,811,337.10 | 134,350,217.33 |
| ——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 45,605,377.31  | 16,071,015.19  |
| ——持有至到期投资                | —              | —              |
| ——可供出售金融资产               | 77,205,959.79  | 118,279,202.14 |
| ——衍生金融工具                 | —              | —              |
| 套期保值取得的投资收益              | -9,486,274.87  | 8,816,168.91   |

| 项 目 | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-----|----------------|----------------|
| 合 计 | 325,126,819.66 | 203,209,003.80 |

(2) 投资收益汇回无重大限制。

(3) 成本法核算的长期股权投资投资收益

| 被投资单位                 | 本期发生额                | 上期发生额 | 本期比上期增减变动的原因 |
|-----------------------|----------------------|-------|--------------|
| 安徽省股权托管交易中心<br>有限责任公司 | 10,000,000.00        | —     | 本报告期分红       |
| 合 计                   | <b>10,000,000.00</b> | —     | —            |

(4) 权益法核算的长期股权投资投资收益

| 被投资单位          | 本期发生额         | 上期发生额         | 本期比上期增减变动的原因 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 长盛基金管理有限公司     | 31,193,726.38 | 28,101,848.16 | 本期净利润增长      |
| 安徽安元投资基金有限公司   | 1,651,605.83  | -232,923.71   | 本期净利润增长      |
| 安徽安元投资基金管理有限公司 | 4,447,128.00  | 2,447,435.78  | 本期净利润增长      |
| 合 计            | 37,292,460.21 | 30,316,360.23 |              |

## 十六、补充资料

### 1、非经常性损益明细表

| 项 目  | 金额           | 说明 |
|--|--------------|----|
| 非流动资产处置损益  | 160,704.40   |    |
| 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）        | 5,877,200.00 |    |
| 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年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  | -5,314,257.96 |  |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目   |               |  |
| 小计  | 723,646.44    |  |
| 所得税影响额  | 191,605.87    |  |
| 少数股东权益影响额（税后）   | 384,957.90    |  |
| 合 计   | 147,082.67    |  |

## 2、净资产收益率及每股收益

| 报告期利润                   | 加权平均净资产收益率<br>(%) | 每股收益（元） |        |
|-------------------------|-------------------|---------|--------|
|                         |                   | 基本每股收益  | 稀释每股收益 |
| 归属于公司普通股股东的净利润          | 2.46              | 0.17    | 0.17   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 2.46              | 0.17    | 0.17   |

## 十七、财务报表的批准报出

本财务报表业经公司董事会于 2017 年 8 月 21 日批准报出。

公司名称：国元证券股份有限公司

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

日期：2017 年 8 月 21 日

## 第十一节 备查文件目录

- (一) 载有公司法定代表人签名的半年度报告文本。
- (二) 载有公司法定代表人、总会计师、会计机构负责人签名并盖章的财务报表。
- (三) 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。
- (四) 其他有关资料。

国元证券股份有限公司

法定代表人：蔡咏

二〇一七年八月二十一日