



南京证券

NANJING SECURITIES

南京证券

NEEQ:833868

南京证券股份有限公司



南京证券

NANJING SECURITIES

年度报告

—2017—

## 公司年度大事记

一、根据中国证监会公布的 2017 年证券公司分类结果,公司获评 A 类 A 级。

二、公司于 2017 年 3 月正式搬入位于南京金融城的新办公大楼,总部由“南京大钟亭 8 号”迁址至“南京江东中路 389 号”。

三、积极开展扶贫工作。积极响应“一司一县”号召,在宁夏同心县设立金融扶贫工作站,采取捐赠资金、协助引入外部投资等方式,从产业、消费等多个方面全力助力同心县全面脱贫;积极响应中国证券业协会号召,向山西省隰县午城镇寺坡村扶贫电站建设项目捐赠建设资金 75 万元。

四、公司在宁夏回族自治区银川市投建的投资者教育基地被正式命名为“宁夏回族自治区证券期货投资者教育基地”,是宁夏首家省级投资者教育基地。

五、公司通过中央精神文明建设指导委员会复查,蝉联“全国文明单位”荣誉称号。

六、公司移动理财服务平台金罗盘成功上线 3.0 版本,完成重大年度升级,并在行业评选中荣获“突破创新奖”。



## 目 录

第一节	声明与提示 .....	4
第二节	公司概况 .....	5
第三节	会计数据和财务指标摘要 .....	12
第四节	管理层讨论与分析 .....	17
第五节	重要事项 .....	38
第六节	股本变动及股东情况 .....	46
第七节	融资及利润分配情况 .....	49
第八节	董事、监事、高级管理人员及员工情况 .....	64
第九节	公司治理及内部控制 .....	77
第十节	财务报告 .....	107

## 释义

释义项目		释义
南京证券/本公司/公司	指	南京证券股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
全国股转公司	指	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
全国股转系统/新三板	指	全国中小企业股份转让系统
江苏证监局	指	中国证券监督管理委员会江苏监管局
章程/公司章程	指	《南京证券股份有限公司章程》
国资集团/南京市国资集团	指	南京市国有资产管理控股(集团)有限责任公司
紫金集团	指	南京紫金投资集团有限责任公司
新工集团	指	南京新工投资集团有限责任公司
凤凰置业	指	江苏凤凰置业有限公司
交通集团	指	南京市交通建设投资控股(集团)有限责任公司
紫金资管	指	南京紫金资产管理有限公司
紫金信托	指	紫金信托有限责任公司
巨石创投	指	南京巨石创业投资有限公司
南证期货	指	南证期货有限责任公司
宁夏股权交易中心	指	宁夏股权托管交易中心(有限公司)
富安达/富安达基金	指	富安达基金管理有限公司
元	指	人民币元
报告期/本期	指	2017年1-12月
上期/上年同期	指	2016年1-12月

本年度报告中,部分合计数与加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异,此类差异系四舍五入造成。

## 第一节 声明与提示

**【声明】**公司董事会及其董事、监事会及其监事、公司高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

公司负责人步国甸、主管会计工作负责人夏宏建及会计机构负责人（会计主管人员）刘宁保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本年度报告涉及未来计划等前瞻性陈述，不构成公司对投资者的实质承诺，投资者及相关人士均应对此保持足够的风险认识，并且应当理解计划、预测与承诺之间的差异。

本年度报告经公司第二届董事会第十四次会议审议通过。会议应到董事15名，实际参会13名（毕胜董事委托吴斐董事、陈传明独立董事委托李心丹独立董事出席会议并代为行使表决权）。未有董事、监事、高级管理人员声明对年度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

事项	是或否
是否存在董事、监事、高级管理人员对年度报告内容异议事项或无法保证其真实、准确、完整	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未出席董事会审议年度报告的董事	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
是否存在豁免披露事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

### 1、列示未出席董事会的董事姓名及未出席的理由

毕胜董事因公务原因未能亲自出席本次董事会会议，委托吴斐董事代为出席并行使表决权。陈传明独立董事因公务原因未能亲自出席本次董事会会议，委托李心丹独立董事代为出席并行使表决权。

### 【重要风险提示表】

重要风险事项名称	重要风险事项简要描述
市场风险	公司的持仓组合因相关市场的不利变化而导致损失的风险
信用风险	公司因借款人或交易对手未能履行约定义务而造成经济损失的风险
业务操作风险	公司各项业务因经营模式选择不当或操作失误对公司造成的风险
流动性风险	公司无法以合理成本及时获得充足资金，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产生的风险
本期重大风险是否发生重大变化：	否

公司盈利来源主要为证券经纪、证券自营、投资银行、资产管理等传统业务，公司业绩与外部经济环境、市场行情、宏观及监管相关政策等高度相关，在市场行情低迷、政策发生变化的情况下，公司的经营状况可能受到较大影响。

公司在日常经营活动中可能面临风险的详细情况，详见“第四节管理层讨论与分析”之“五、风险因素”。

## 第二节 公司概况

### 一、 基本信息

公司中文全称	南京证券股份有限公司
英文名称及缩写	Nanjing Securities Co., Ltd.; 缩写: NSC
证券简称	南京证券
证券代码	833868
法定代表人	步国旬
总裁	李剑锋
办公地址	南京市江东中路 389 号

### 二、 联系方式

董事会秘书或信息披露事务负责人	邱楠
是否通过董秘资格考试	否
电话	86-025-83367888
传真	86-025-83367377
电子邮箱	office@njzq.com.cn
公司网址	http://www.njzq.com.cn
联系地址及邮政编码	南京市江东中路 389 号 (邮编: 210019)
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn 或 v2.neeq.com.cn
公司年度报告备置地	南京市江东中路 389 号

### 三、 企业信息

股票公开转让场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1990 年 11 月 23 日
挂牌时间	2015 年 10 月 30 日
分层情况	基础层
行业 (挂牌公司管理型行业分类)	“J 金融业-J67 资本市场服务-J671 证券市场服务”
主要产品与服务项目	证券经纪、证券自营、资产管理、投资银行、信用交易等业务
普通股股票转让方式	协议转让
普通股总股本 (股)	2,473,999,503
优先股总股本 (股)	0
做市商数量	0
控股股东	南京紫金投资集团有限责任公司
实际控制人	南京市国有资产投资管理控股 (集团) 有限责任公司



#### 四、 注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	91320100134881536B	否
注册地址	南京市江东中路 389 号	是
注册资本	247,399.9503 万元	否

经江苏证监局批复和南京市工商行政管理局批准，公司住所已于 2017 年 5 月由“南京市玄武区大钟亭 8 号”变更为“南京市江东中路 389 号”。

#### 五、 中介机构

主办券商	中信证券
主办券商办公地址	深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
报告期内主办券商是否发生变化	否
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
签字注册会计师姓名	孙晓爽、孙淑平
会计师事务所办公地址	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼

#### 六、 报告期后更新情况

√适用 □不适用

2018 年 1 月 15 日，新三板交易方式变更后，公司股票转让方式为集合竞价。

#### 七、 公司经营范围和单项业务资格

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；融资融券；证券资产管理；证券投资基金代销；代销金融产品；为期货公司提供中间介绍业务。
单项业务资格	经营外汇业务资格、网上证券委托业务资格、上海证券交易所大宗交易系统合格投资者资格、开放式证券投资基金代销业务资格、中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与者资格、全国银行间同业拆借市场成员资格、全国银行间市场信用风险缓释工具交易商资格、上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格、上证基金通业务资格、实施证券经纪人制度资格、短期融资券承销业务资格、期货 IB 业务资格、定向资产管理业务资格、客户资金第三方存管下单客户多银行服务资格、自营业务参与股指期货交易资格、资产管理业务参与股指期货交易资格、设立全资子公司开展直接投资业务资格、保险兼业代理人资格、约定购回式证券交易资格、自营业务参与利率互换交易资格、中小企业私募债承销商资格、全国股转系统主办券商资格、转融通（转融资）业务借



入人资格、非现场开户业务资格、股票质押式回购交易业务资格、代理证券质押登记业务资格、融资融券证券出借交易资格、全国股转系统做市商做市业务资格、港股通业务交易权限、柜台市场试点资格、互联网证券业务试点资格、转融券业务试点资格、期权结算业务资格、上海证券交易所股票期权交易参与人资格、深圳证券交易所上市公司股权激励行权融资业务资格、私募基金综合托管业务资格、军工涉密业务咨询服务资格、企业债券直接投资人资格、银行间债券市场尝试做市业务资格、深港通下港股通业务交易权限等。

## 八、公司历史沿革

南京证券股份有限公司前身为南京市证券公司，于 1990 年 10 月经中国人民银行银复〔1990〕356 号文批准成立，同年 12 月 12 日开业，初始注册资金为 1,000 万元。经 1996 年 12 月中国人民银行银办函〔1996〕391 号文及 1998 年 12 月中国证监会证监机字〔1998〕45 号文批复同意，公司注册资本增至 10,470 万元，公司更名为“南京证券有限责任公司”。经 2002 年 12 月中国证监会证监机构字〔2002〕344 号文批复，公司注册资本增至 65,859.03 万元，并完成对南京市国际信托投资公司和南京市信托投资公司所属 7 家证券营业部的重组。经 2006 年 9 月中国证监会证监机构字〔2006〕218 号文核准，公司注册资本增至 102,228.23 万元。经 2008 年 8 月中国证监会证监许可〔2008〕1073 号文批复，注册资本增至 177,105.2 万元。经 2011 年 9 月江苏证监局苏证监机构字〔2011〕508 号文批复，公司注册资本增至 187,905.195079 万元。经 2012 年 9 月中国证监会证监许可〔2012〕1217 号文批复，公司整体变更为股份有限公司，变更后公司名称为“南京证券股份有限公司”，注册资本为 190,000 万元。经全国股转公司《关于同意南京证券股份有限公司股票在全国中小企业股份转让系统挂牌的函》（股转系统函〔2015〕6423 号）同意，公司股票于 2015 年 10 月 30 日在全国股转系统公开转让。2015 年 11 月，公司注册资本增至 247,399.9503 万元，江苏证监局已就本次增资向公司出具了备案回执。

## 九、公司组织结构

公司设有股东大会、董事会、监事会和总裁室。董事会下设合规与风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会等三个专门委员会。

公司经营层面设有风险控制委员会、证券投资决策委员会、资产管理业务投资决策委员会、投资银行风险控制委员会、证券发行内核小组、投资银行发行定价小组、固定收益投资决策委员会、固定收益产品发行审核委员会、信用交易业务决策委员会、全国中小企业股份转让系统推荐挂牌业务内核小组、新股发行询价对象推荐决策委员会、柜台市场管理委员会、做市业务决策委员会及分支机构金融产品销售业务决策委员会等，并设有办公室、董事会办公室、创新发展办公室、党建工作部、人力资源部、监察室、计划财务部、行政保卫部、工会办公室、稽核部、合规管理部、风险管理部、研究所、结算存管中心、信息技





术总部、网络金融部、营销管理中心、经纪业务管理总部、投资管理总部、资产管理总部、投资银行业务总部、股转业务总部、投资银行运营内控部、固定收益总部、场外业务管理总部、金融衍生品部、并购业务部、信用交易管理部、培训中心等 29 个职能部门。报告期末，公司共有 15 家分公司及 86 家证券营业部。

## 十、公司重要分公司、子公司情况

### (一) 分公司

报告期末，公司共有分公司 15 家，具体情况如下：

名称	地址	设立时间	营运资金 (万元)	负责人	联系电话
宁夏分公司	宁夏银川市民族北街 15 号 4-5 楼	2009 年 6 月 11 日	600	王胜	0951-6024716
深圳分公司	深圳市福田区福田街道深南中路 3003 号北方大厦 415、416、417、421	2009 年 6 月 18 日	2000	李铮	0755-83279378
连云港分公司	连云港市新浦区海连中路国安商城一期二楼 0-20#	2012 年 4 月 25 日	500	闻长兵	0518-85510393
上海分公司	上海西藏南路 1332 号 5 楼 8503	2012 年 5 月 7 日	2100	瞿建	021-53188782
南通分公司	南通市姚港路 10 号	2013 年 9 月 11 日	600	瞿德林	0513-85585578
盐城分公司	盐城市城南新区新都街道解放南路 261 号 102、301 室 (CND)	2013 年 9 月 13 日	500	刘有锦	0515-66660809
镇江分公司	镇江市中山东路 288 号-1 号	2013 年 9 月 16 日	600	邵星	0511-85248167
北京分公司	北京市朝阳区东三环南路 19 号院 1 号楼-2 至 15 层 101 内甲段四层 M08/M11/M15/M17/M10	2013 年 9 月 16 日	600	焦健	010-87820580
苏州分公司	苏州工业园区时代广场 23 幢 B 座 206 室	2013 年 9 月 17 日	600	严子禹	0512-62888776
无锡分公司	无锡市五爱北路 97 号金置广场四楼 4-1 至 4-7	2013 年 9 月 23 日	500	傅金发	0510-82809808
云南分公司	云南省昆明市人民西路 207 号保利六合 1 号写字楼 4 层	2013 年 9 月 23 日	600	黄卫	0871-65342316
常州分公司	常州市新北区太湖东路 101 号豪庭花园 17-2 商铺	2013 年 9 月 25 日	500	袁俊峰	0519-69880909
重庆分公司	重庆市渝中区较场口得意商厦 88 号 A 塔 5-02	2013 年 9 月 26 日	500	袁希平	023-63798302
南京分公司	江苏省南京市大钟亭 8 号	2016 年 2 月 19 日	-	王彤	025-83613112
江西分公司	江西省南昌市西湖区洪城路 778 号星河国际 2127、2128 室	2016 年 3 月 9 日	2000	邓燕娟	0791-88555356

### (二) 子公司

报告期末，公司全资直接拥有南证期货有限责任公司、南京巨石创业投资有限公司 2 家子公司，并控股宁夏股权托管交易中心（有限公司）。

名称	地址	设立时间	注册资本	持股比例	负责人	联系电话	经营范围
南证期货有限	南京市秦淮区长乐	1995 年	12,575	100%	夏涛	025-528	商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨



名称	地址	设立时间	注册资本	持股比例	负责人	联系电话	经营范围
责任公司	路 226 号长乐花园 01 幢 1 号-4, 1 号-7, 1 号-8	5 月	万元			65001	询, 资产管理。(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)
南京巨石创业投资有限公司	南京市玄武区玄武大道 699-1 号徐庄管委会行政楼三楼	2012 年 5 月	30,000 万元	100%	夏宏伟	025-577 10531	股权投资; 股权投资的财务顾问服务; 设立直投资基金, 进行股权投资; 将闲置资金投资于依法公开发行的国债、投资级公司债、货币市场基金、央行票据等风险较低、流动性较强的证券, 以及证券投资基金、集合资产管理计划或者专项资产管理计划。(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)
宁夏股权托管交易中心 (有限公司)	银川市金凤区广场东街 219 号建材大厦 18 楼	2015 年 6 月	6,000 万元	51%	金国斌	0951-85 03229	为企业办理股权集中登记托管, 提供确权、非交易过户、挂失、查询、分红派息和股权质押登记服务; 为企业股权、债权、资产支持证券和其他权益类产品及金融产品的挂牌、交易、鉴证、过户、结算及咨询和信息发布等提供场所、设施和服务; 为企业和投资人提供相关培训、财务顾问、受托资产管理、投资管理服务; 其他经监管部门核准的业务。(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)

报告期末, 公司全资子公司南京巨石创业投资有限公司拥有 2 家控股子公司, 具体情况如下:

名称	地址	设立时间	注册资本	持股比例	负责人	联系电话	经营范围
南京巨石金川股权投资基金管理有限公司	南京市玄武区大钟亭 8 号	2016 年 02 月 23 日	5,000 万元	95%	夏宏伟	025-577 10531	受托管理私募股权投资基金, 从事投资管理及相关咨询服务业务 (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)
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	宁夏银川市兴庆区民族北街 15 号	2016 年 05 月 17 日	1,000 万元	51%	赵贵成	0951-85 03236	股权投资、债权投资、投资与股权投资、股权投资相关的投资基金、受托管理私募股权投资基金、从事投资管理及相关咨询服务业务(不得从事非法集资、吸收公众资金等金融活动)。

## 十一、公司营业部数量和分布情况

截至报告期末, 公司共有证券营业部 86 家, 其中 A 类 25 家, B 类 27 家, C 类 34 家。营业部在各省 (自治区、直辖市) 的分布情况为: 江苏省 42 家, 宁夏回族自治区 15 家, 上海市 5 家, 浙江省 3 家, 广东省 3 家, 重庆市 3 家, 云南省 3 家, 北京市 2 家, 福建省 2 家, 陕西省 2 家, 江西省 2 家, 山东省、湖南省、广西壮族自治区及湖北省等各 1 家。详细情况如下:

序号	所在地区	营业部名称	地址
1	江苏	南京大钟亭证券营业部	南京市大钟亭 8 号
2		南京龙蟠路证券营业部	江苏省南京市玄武区龙蟠路 9 号 201、202、301 室
3		南京常府街证券营业部	南京市常府街 33 号
4		南京新华路证券营业部	南京市新华路 139 号
5		南京中山北路证券营业部	南京市中山北路 202 号
6		南京中山南路证券营业部	南京市中山南路 311 号
7		南京长乐路证券营业部	南京市长乐路 226 号
8		南京云南北路证券营业部	南京市云南北路 28 号
9		南京热河路证券营业部	南京市热河路 8 号



序号	所在地区	营业部名称	地址
10	南京	南京软件大道证券营业部	江苏省南京市雨花台区软件大道119号3幢4室一层
11		南京高淳淳溪镇宝塔路证券营业部	南京市高淳区淳溪镇宝塔路5号
12		南京溧水康利广场证券营业部	南京市溧水区永阳镇致远路68号康利华府C幢105、106、107室
13		南京新亭路证券营业部	南京市江宁区秣陵街道新亭路9号市政天元城18幢105室
14		南京尧佳路证券营业部	南京市栖霞区尧佳路7号上城风景北苑17幢17-2号
15		南京柳洲南路证券营业部	南京市浦口区柳洲南路5号乐美颂商业社区用房112室
16		南京江东中路证券营业部	南京市建邺区江东中路389号
17		连云港通灌南路证券营业部	连云港市新浦通灌南路1号2楼
18		连云港墟沟中华西路证券营业部	连云港市墟沟中华西路25号2、5楼
19		连云港赣榆黄海路证券营业部	江苏省连云港市赣榆区青口镇黄海路25号工行二楼
20		无锡五爱北路证券营业部	无锡市五爱北路97号金置广场四楼
21		宜兴教育西路证券营业部	宜兴市宜城街道教育西路21号803室
22		江阴人民中路证券营业部	江阴市人民中路289-2号泓昇商务大厦17-18楼
23		常熟吉祥商城证券营业部	常熟市吉祥商城1号楼
24		吴江松陵镇笠泽路证券营业部	苏州市吴江区松陵镇笠泽路110号-401商铺
25		张家港步行街证券营业部	张家港市步行街49号
26		镇江中山东路证券营业部	镇江市中山东路288-1号
27		镇江句容宝塔路证券营业部	句容市华阳镇宝塔路E块底层
28		镇江丹阳水关路证券营业部	丹阳市水关路台阳小区15-17号门市房
29		扬中江洲南路证券营业部	扬中市江洲南路8号
30		金坛东环二路证券营业部	常州市金坛区东环二路206-1号
31		靖江骥江路证券营业部	靖江市骥江路276号4楼
32		南通姚港路证券营业部	南通市姚港路10号
33		盱眙淮河北路证券营业部	盱眙县城淮河北路(商贸中心)1-34
34		盐城建湖县人民路证券营业部	建湖县城人民路建湖书城五楼
35		徐州解放北路证券营业部	江苏省徐州市鼓楼区锦绣茗都商办楼1号楼1-111
36		宿迁黄河路证券营业部	宿迁市宿城区兴鸿名城北楼二区107-1、107-2号
37		南通中南世纪城证券营业部	江苏省南通市中南世纪城14幢1205、1206室
38		常州太湖东路证券营业部	江苏省常州市新北区太湖东路101号豪庭花园17-2商铺一层
39		苏州时代广场证券营业部	江苏省苏州工业园区时代广场23幢B座206室
40		盐城解放南路证券营业部	江苏省盐城市城南新区新都街道解放南路261号102室
41		江阴澄杨路证券营业部	江苏省江阴市澄杨路206号云亭街道 绮山松桥雅园6号101/106区
42		溧阳罗湾路证券营业部	江苏省溧阳市罗湾路302号西边壹间1-2层
43	宁夏	银川民族北街证券营业部	银川市民族北街15号
44		银川凤凰北街证券营业部	银川市凤凰北街21号
45		银川正源南街证券营业部	宁夏银川市金凤区正源南街91号锦绣苑24号楼 14号营业房1-3层
46		银川怀远西路证券营业部	银川市怀远西路77号
47		银川文化东街证券营业部	银川市文化东街74号
48		银川新华东街证券营业部	银川市新华东街43号
49		银川中山北街证券营业部	银川市中山北街24号
50		银川燕鸽湖证券营业部	银川市燕鸽湖燕兴路二区三段营业房22号
51		吴忠迎宾大街证券营业部	吴忠市迎宾大街古城路90号
52		石嘴山大武口证券营业部	石嘴山市大武口区鸣沙路79号盛鼎商务中心C座三楼
53		石嘴山富强西路证券营业部	宁夏石嘴山市惠农区富强西路13号



序号	所在地区	营业部名称	地址
54		石嘴山平罗团结西路 证券营业部	宁夏石嘴山市平罗县团结西路延伸段北侧 星海花园北园小区3号商住楼2-B号
55		中卫证券营业部	中卫市鼓楼南街美利城市风景商业楼五、六层
56		固原证券营业部	固原市原州区中山街227号固原工商银行三楼
57		吴忠同心利民街证券营业部	宁夏回族自治区同心县豫海镇利民街荣世商业广场 9号楼8-17号营业房8号一楼
58	北京	北京东三环南路证券营业部	北京市朝阳区东三环南路19号院1号楼甲段4层
59		北京南大街证券营业部	北京市怀柔区南大街25号楼1层25-1室
60	上海	上海南车站路证券营业部	上海市黄浦区南车站路69弄1号华教大厦2楼
61		上海番禺路证券营业部	上海市徐汇区番禺路878号B座
62		上海西藏南路证券营业部	上海市西藏南路1332号
63		上海浦东新区下南路 证券营业部	上海市浦东新区下南路886号一层
64		上海浦东新区东方路 证券营业部	上海市浦东新区东方路738号1307室
65	浙江	杭州新塘路证券营业部	杭州市新塘路65号元华旺座B座14楼
66		宁波锦寓路证券营业部	宁波市鄞州区锦寓路672号
67		绍兴新昌人民西路 证券营业部	绍兴市新昌县人民西路172号
68	福建	福州华林路证券营业部	福州市华林路201号华林大厦10层
69		宁德福鼎天湖路证券营业部	福建省宁德市福鼎市天湖路258号
70	江西	南昌洪城路证券营业部	南昌市洪城路778号星河国际21楼
71		九江九龙街证券营业部	九江市浔阳区九龙街步红花园东区高住楼111-112号
72	山东	临沂通达路证券营业部	山东省临沂市兰山区通达路36号城建时代广场一楼
73	湖南	长沙湘府西路证券营业部	长沙市天心区湘府西路31号尚玺苑20栋104、610号
74	广东	广州体育西路证券营业部	广州市天河区体育西路111-115单号10楼C2-D1
75		深圳深南中路证券营业部	深圳市福田区福田街道深南中路3003号 北方大厦三楼(301)、四楼(418、419、422)
76		深圳科园路证券营业部	深圳市南山区粤海街道科技园路1003号 软件产业基地2栋裙楼02层07号
77	广西	南宁竹溪大道证券营业部	广西南宁市青秀区竹溪大道36号青湖中心2层
78	重庆	重庆较场口证券营业部	重庆市渝中区较场口得意世界A座5楼
79		重庆义学路证券营业部	重庆市义学路2号第4层
80		重庆松牌路证券营业部	重庆市松牌路523号金龙商厦1幢1单元5-2
81	云南	昆明人民西路证券营业部	云南省昆明市人民西路207号保利六合1号写字楼4层
82		楚雄永安路证券营业部	云南省楚雄彝族自治州楚雄市开发区永安路145号 格瑞时代综合楼第1层3、4号
83		丽江香格里拉大道证券营业部	丽江市古城区香格里拉大道1261号
84	陕西	榆林定边献忠路证券营业部	陕西省榆林市定边县新区献忠路荣泰小区6-7号
85		西安高新二路证券营业部	陕西省西安市高新区高新二路12号协同大厦4层D座1号
86	湖北	武汉新华路证券营业部	武汉市江汉区新华路139号凯盟大厦3楼310室

注:截至本报告签署日,银川中山北街证券营业部已迁址至宁夏银川市湖滨东街354号并更名为银川湖滨东街证券营业部;宿迁黄河路证券营业部已迁址至江苏省宿迁市宿城区洪泽湖路587号并更名为宿迁洪泽湖路证券营业部。

### 第三节 会计数据和财务指标摘要

#### 一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例
营业收入	1,384,562,680.80	1,499,611,313.01	-7.67%
利润总额	543,539,806.42	648,429,263.26	-16.18%
归属于挂牌公司股东的净利润	410,602,756.36	493,557,293.51	-16.81%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	406,744,610.60	484,444,696.42	-16.04%
其他综合收益	-10,367,987.31	34,231,524.41	-130.29%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	4.42%	5.36%	-
加权平均净资产收益率%（归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	4.38%	5.26%	-
基本每股收益	0.17	0.20	-15.00%
经营活动产生的现金流量净额	-1,056,716,132.59	-3,097,455,541.18	65.88%

#### 二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例
资产总计	23,501,546,945.82	26,858,367,957.04	-12.50%
负债总计	14,101,292,180.82	17,578,325,285.26	-19.78%
归属于挂牌公司股东的净资产	9,366,633,186.64	9,248,029,892.30	1.28%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	3.79	3.74	1.28%
资产负债率%（母公司）	41.76%	44.99%	-
资产负债率%（合并）	42.85%	46.97%	-
流动比率	304%	501%	-
利息保障倍数	2.97	2.16	-

#### 三、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例
总资产增长率%	-12.50%	-37.42%	-
营业收入增长率%	-7.67%	-50.01%	-
净利润增长率%	-16.51%	-65.06%	-



#### 四、 股本情况

单位: 股

	本期期末	上年期末	增减比例
普通股总股本	2,473,999,503	2,473,999,503	0%
计入权益的优先股数量	0	0	-
计入负债的优先股数量	0	0	-
带有转股条款的债券	0	0	-
期权数量	0	0	-

#### 五、 非经常性损益

单位: 元

项目	金额
非流动性资产处置损益, 包括已计提资产减值准备的冲销部分;	-495,206.86
计入当期损益的政府补助, 但与公司正常经营业务密切相关, 符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外;	7,075,172.33
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益;	2,416,896.20
除上述各项之外的其他营业外收入和支出;	-2,713,608.60
<b>非经常性损益合计</b>	<b>6,283,253.07</b>
所得税影响数	1,092,719.36
少数股东权益影响额 (税后)	1,332,387.95
<b>非经常性损益净额</b>	<b>3,858,145.76</b>

#### 六、 净资本及风险控制指标

报告期末, 母公司净资本为 7,416,833,648.53 元, 其中核心净资本 7,416,833,648.53 元, 分别较年初减少 4.90% 和 0.43%。报告期内, 公司净资本等相关风险控制指标符合监管要求。

单位: 元

	本期期末	本期期初	增减比例
净资本	7,416,833,648.53	7,798,926,882.52	-4.90%
其中: 核心净资本	7,416,833,648.53	7,448,926,882.52	-0.43%
附属净资本	0.00	350,000,000.00	-100.00%
净资产	9,321,161,256.26	9,206,333,597.61	1.25%
各项风险资本准备之和	1,675,819,775.29	1,631,591,020.37	2.71%
表内外资产总额	16,104,572,261.57	16,824,212,811.83	-4.28%
风险覆盖率 (%)	442.58%	478.00%	-
资本杠杆率 (%)	46.06%	44.35%	-
流动性覆盖率 (%)	742.43%	701.57%	-
净稳定资金率 (%)	143.85%	147.57%	-





净资本/净资产(%)	79.57%	84.71%	-
净资本/负债(%)	110.97%	103.76%	-
净资产/负债(%)	139.46%	122.49%	-
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	4.11%	20.63%	-
自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	57.84%	58.78%	-
融资(含融券)的金额/净资本(%)	106.14%	82.05%	-

## 七、 因会计政策变更及会计差错更正等追溯调整或重述情况

适用 不适用

单位：元

科目	上年期末（上年同期）		上上年期末（上上年同期）	
	调整重述前	调整重述后	调整重述前	调整重述后
营业外收入	18,685,214.18	11,387,037.08	-	-
资产处置收益	-	7,298,177.10	-	-
持续经营净利润	-	493,719,756.21	-	-
终止经营净利润	-	-	-	-

根据财政部于 2017 年颁布的《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》（财会[2017]13 号）和《企业会计准则第 16 号——政府补助》（财会[2017]15 号），经董事会审议通过，公司对相关会计政策进行了变更（详见公司于 2017 年 8 月 28 日在全国股转系统官方网站披露的《会计政策变更公告》（公告编号：2017-043 号））。针对上述两项会计准则的规定，财政部于 2017 年 12 月 25 日发布财会[2017]30 号《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》，对一般企业财务报表格式进行了修订。根据该文件规定，公司 2017 年度财务报表格式作了相应调整，在利润表营业收入项下新设“资产处置收益”、“其他收益”项目，在利润表中分别列示“持续经营净利润”和“终止经营净利润”项目。

“资产处置收益”项目：将部分原列示为“营业外收入”的资产处置损益重分类至“资产处置收益”项目。按照《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》等的相关规定，对可比期间的比较数据按规定进行调整。因此将 2016 年度原营业外收入中的资产处置损益 729.82 万元，重分类至资产处置收益项目。

“其他收益”项目：按照《企业会计准则第 16 号——政府补助》的相关规定，对 2017 年 1 月 1 日存在的政府补助采用未来适用法处理，无需对可比期间的比较数据进行调整。

“持续经营净利润”和“终止经营净利润”项目：根据《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》的相关规定，企业应当在利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益，对可比期间的比较数据相应调整。2016 年持续经营净利润为 49,371.98 万元，终止经营净利润为零。

## 八、 业绩预告、业绩快报的差异说明

适用 不适用



## 九、根据证监会《证券公司年度报告内容和格式准则》(2013年修订)规定应披露的财务数据

单位:元

项 目	合并报表			母公司报表		
	期末数 (本年数)	期初数 (上年数)	增减 (%)	期末数 (本年数)	期初数 (上年数)	增减 (%)
<b>一、资产负债表项目</b>						
货币资金	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93	-29.40	5,699,497,247.63	8,205,012,195.04	-30.54
应收款项	5,483,767.31	6,771,393.56	-19.02	6,124,625.65	9,816,176.34	-37.61
长期股权投资	242,574,996.31	97,581,710.02	148.59	696,593,852.93	578,631,710.02	20.39
固定资产	994,816,129.84	311,626,372.53	219.23	991,553,675.77	307,665,194.80	222.28
在建工程	-	648,318,365.22	-100.00	-	648,318,365.22	-100.00
其他资产	53,493,570.67	39,627,969.58	34.99	49,602,378.33	30,830,699.95	60.89
<b>资产总额</b>	<b>23,501,546,945.82</b>	<b>26,858,367,957.04</b>	<b>-12.50</b>	<b>22,492,131,217.40</b>	<b>25,405,704,227.89</b>	<b>-11.47</b>
应付短期融资款	1,653,910,000.00	-	-	1,663,910,000.00	-	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	57,720,060.00	-100.00	-	57,720,060.00	-100.00
衍生金融负债	1,051,600.00	-	-	1,051,600.00	-	-
代理承销证券款	953,688.33	108,297.15	780.62	953,688.33	108,297.15	780.62
应付利息	66,306,015.98	158,183,552.16	-58.08	66,614,783.10	158,183,552.16	-57.89
预计负债	541,766.60	13,008,420.00	-95.84	541,766.60	13,008,420.00	-95.84
应付债券	1,697,179,834.23	4,200,000,000.00	-59.59	1,697,179,834.23	4,200,000,000.00	-59.59
递延所得税负债	7,315,431.46	12,946,930.48	-43.50	7,102,594.96	12,946,930.48	-45.14
其他负债	510,096,731.63	832,384,174.74	-38.72	145,125,277.44	153,034,318.71	-5.17
<b>负债总额</b>	<b>14,101,292,180.82</b>	<b>17,578,325,285.26</b>	<b>-19.78</b>	<b>13,170,969,961.14</b>	<b>16,199,370,630.28</b>	<b>-18.69</b>
其他综合收益	-10,367,987.31	34,231,524.41	-130.29	-9,277,191.17	37,054,547.54	-125.04
<b>所有者权益合计</b>	<b>9,400,254,765.00</b>	<b>9,280,042,671.78</b>	<b>1.30</b>	<b>9,321,161,256.26</b>	<b>9,206,333,597.61</b>	<b>1.25</b>
<b>二、利润表项目</b>						
<b>营业收入</b>	<b>1,384,562,680.80</b>	<b>1,499,611,313.01</b>	<b>-7.67</b>	<b>1,323,717,608.97</b>	<b>1,499,246,460.30</b>	<b>-11.71</b>
手续费及佣金净收入	646,690,825.87	1,015,800,768.29	-36.34	612,912,799.11	980,293,919.88	-37.48
其中:投资银行业务手续费净收入	88,669,210.48	254,862,656.79	-65.21	89,712,952.96	256,789,665.03	-65.06
利息净收入	448,592,200.42	311,222,099.44	44.14	435,793,487.10	312,318,137.56	39.54
资产处置收益(损失以“-”号填列)	69,361.70	7,298,177.10	-99.05	43,746.24	7,298,177.10	-99.40
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	32,776,867.02	-123,132,828.95	126.62	35,246,817.42	-66,102,251.83	153.32
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-1,882,698.01	1,959,235.53	-196.09	-1,882,698.01	1,959,235.53	-196.09
其他收益	2,390,000.00	-	-	-	-	-
税金及附加	16,201,030.60	45,128,833.96	-64.10	15,593,573.96	44,212,267.20	-64.73
资产减值损失	5,468,095.69	-757,453.34	821.91	5,443,282.39	-4,770,795.29	214.10
<b>净利润</b>	<b>412,211,555.24</b>	<b>493,719,756.21</b>	<b>-16.51</b>	<b>408,559,347.66</b>	<b>532,757,688.88</b>	<b>-23.31</b>





项 目	合并报表			母公司报表		
	期末数 (本年数)	期初数 (上年数)	增减 (%)	期末数 (本年数)	期初数 (上年数)	增减 (%)
归属于母公司股东的净利润	410,602,756.36	493,557,293.51	-16.81			
少数股东损益	1,608,798.88	162,462.70	890.26			
其他综合收益的税后净额	-44,599,511.72	-119,714,099.76	62.74	-46,331,738.71	-177,574,755.54	73.91
综合收益总额	367,612,043.52	374,005,656.45	-1.71	362,227,608.95	355,182,933.34	1.98
归属于少数股东的综合收益总额	1,608,798.88	162,462.70	890.26			
<b>三、现金流量表项目</b>						
经营活动产生的现金流量净额	-1,056,716,132.59	-3,097,455,541.18	65.88	-1,405,578,598.23	-2,882,136,091.55	51.23
投资活动产生的现金流量净额	-201,257,161.24	-182,070,848.31	-10.54	-157,847,781.86	-379,834,311.45	58.44
筹资活动产生的现金流量净额	-1,738,163,744.91	-2,414,448,046.47	28.01	-1,390,482,369.40	-2,468,458,498.03	43.67
汇率变动对现金及现金等价物的影响	-1,882,698.01	1,959,235.53	-196.09	-1,882,698.01	1,959,235.53	-196.09
现金及现金等价物净增加额	-2,998,019,736.75	-5,692,015,200.43	47.33	-2,955,791,447.50	-5,728,469,665.50	48.40
期末现金及现金等价物余额	8,136,835,013.49	11,134,854,750.24	-26.92	7,622,739,144.26	10,578,530,591.76	-27.94

## 第四节 管理层讨论与分析

### 一、 业务概要

#### 商业模式:

公司的主要业务是向个人投资者、机构投资者以及企业客户提供专业证券服务和金融产品,并从事相关金融产品的自营投资。公司的业务范围涵盖证券经纪,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,融资融券,证券资产管理,证券投资基金代销,代销金融产品以及为期货公司提供中间介绍业务等。此外,公司还通过子公司南证期货开展期货业务,通过子公司巨石创投开展私募投资基金业务,通过子公司宁夏股权交易中心开展股权托管等相关业务。公司及子公司的经营模式主要是通过开展相关业务,提供专业服务,获取手续费、管理费、佣金收入、业绩报酬以及通过证券投资、股权投资等业务获取投资收益等。

截至本报告签署日,公司的商业模式较上年度未发生较大变化。

#### 核心竞争力分析:

适用 不适用

一、经营风格稳健。公司在业务经营、合规管理、风险管理及内部控制等工作中,秉承“稳健、规范、勤俭、和睦”的企业精神,形成了“正规、正统、正道”的企业文化和稳健的经营管理风格,积累了较为丰富的证券行业经营管理经验。自公司成立以来,保持着从未亏损、持续盈利、稳定回报的优秀经营业绩。

二、管理团队专业稳定。公司管理团队拥有丰富的金融、证券行业管理经验,大都成长自公司各个业务领域,熟悉资本市场和公司情况,对公司经营理念和企业文化高度认同。公司管理层倡导市场化的绩效考核与激励机制,严守合规经营理念,持续强化决策效率和执行能力。公司的管理团队持续保持稳定,为切实执行公司中长期战略发展提供了保障。

三、业务平台完整。公司目前拥有包括证券经纪、证券承销与保荐、证券自营、资产管理、财务顾问、融资融券、代销金融产品等在内的较为完整的业务资质,同时控股一家期货公司和一家私募基金管理公司,作为主要股东参股一家基金管理公司,已经搭建起较为完整的业务发展平台,为拓展公司收入来源、提升盈利能力奠定了良好基础。

四、区位优势明显。江苏省的综合经济实力一直处于全国前列。公司作为总部在南京的综合性证券公司,牢牢把握区域经济发达及资本市场快速发展带来的契机,对各项业务进行针对性布局。公司以长三角地区为核心,以宁夏为中西部地区战略立足点,向全国拓展业务



的区域布局已经形成。

#### 报告期内变化情况:

事项	是或否
所处行业是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主营业务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主要产品或服务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
客户类型是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
关键资源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
销售渠道是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
收入来源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
商业模式是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

## 二、 经营情况回顾

### (一) 经营计划

2017年,全球经济方面,发达经济体和新兴经济体同步复苏。国内经济方面,2017年GDP增速6.9%,较2016年提高0.2个百分点。随着顶层政策设计日趋完善,宏观审慎管理手段日益丰富,金融监管持续推进,国内资产价格泡沫得到有效抑制,资金形成脱虚入实势头,企业盈利逐步改善,经济增长呈现较强韧性。面对复杂的市场环境和不断趋严的行业监管形势,公司紧扣“提升绩效、防范风险、强化合规、稳中求进”的工作总基调,攻坚克难、奋力拼搏,各项工作继续保持平稳健康的发展态势。公司在2017年证券公司分类评价中继续保持A类A级。

1、积极推进转型突破,全力创收,经营业绩稳健。报告期内,各业务条线及子公司努力挖掘发展潜力,积极开辟新的市场空间,全力开拓业务,公司全年实现营业收入13.85亿元,实现利润总额5.44亿元,实现归属于母公司股东净利润4.11亿元,经营发展保持稳健势头。

2、坚决落实监管要求,全面加强合规风控工作。公司根据监管要求积极强化合规风控工作,完善合规风控制度体系和组织架构,充实人员配备,推进系统建设,坚持合规风控与业务发展的动态平衡;全力做好投资者适当性管理工作,强化子公司风险管控,建立完善母子公司统一管控的合规风控体系。

3、强化中后台支撑,积极提升运营保障能力。优化部门组织架构,有序推进分支机构新设网点,报告期内在南京和武汉新设2家营业部;优化激励约束机制,加强人才引进力度和人才队伍建设;顺利完成新数据中心搬迁至新总部大楼的工作,并根据业务发展需要,新建和完善相关业务系统,报告期内近百套业务系统安全稳定运行。



## (二) 行业情况

证券行业作为强周期行业，其发展状况与市场波动高度关联。在去通道、降杠杆的环境下，受股票及债券市场景气度影响，证券行业盈利水平较 2016 年有所下降。根据中国证券业协会统计，证券公司 2017 年度未经审计财务报表显示，131 家证券公司当期实现营业收入 3,113.28 亿元，实现净利润 1,129.95 亿元，同比分别下降 5.08% 和 8.47%。

报告期内，受益于股票质押规模快速上升和价值蓝筹股带来的结构性行情，资本中介业务和自营业务对证券公司利润贡献有所增加，但个股价格波动造成的信用风险对证券公司的风险管理能力形成较大挑战；经纪业务方面，行业佣金率下降趋势有所缓解，但市场份额竞争激烈，受市场低迷和佣金率下滑等因素影响，盈利对证券公司利润贡献有所下降；投资银行业务方面，在 IPO 常态化、再融资收缩及债券市场调整的大背景下，收入结构发生显著变化，IPO 收入占比显著提升，再融资、债券承销等其他业务收入占比相应下降；资产管理业务方面，受严监管政策等影响，资产管理业务规模有所收缩，行业业务重心逐步回归主动管理。

从中长期看，证券行业积极寻求传统业务转型、业务增值，业务种类逐步拓宽。同时，监管层通过各项政策增强金融服务实体经济能力，提高直接融资比重，促进多层次资本市场健康发展，加之企业直接融资和居民财富管理需求空间巨大，后续行业收入和盈利有望进一步改善，结构有望进一步优化。

## (三) 财务分析

### 1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		本期期末与上年期末金额变动比例
	金额	占总资产的比重	金额	占总资产的比重	
货币资金	6,234,345,394.63	26.53%	8,830,132,770.93	32.88%	-29.40%
结算备付金	1,902,489,618.86	8.10%	2,304,721,979.31	8.58%	-17.45%
拆出资金					
融出资金	5,571,725,233.58	23.71%	5,518,927,173.70	20.55%	0.96%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,957,691,496.37	8.33%	2,203,608,567.02	8.20%	-11.16%
买入返售金融资产	3,489,334,761.40	14.85%	3,733,511,978.64	13.90%	-6.54%
应收款项	5,483,767.31	0.02%	6,771,393.56	0.03%	-19.02%



应收利息	173,612,883.56	0.74%	175,766,718.01	0.65%	-1.23%
存出保证金	326,324,109.59	1.39%	390,655,953.63	1.45%	-16.47%
可供出售金融资产	2,471,278,138.55	10.52%	2,500,758,263.12	9.31%	-1.18%
长期股权投资	242,574,996.31	1.03%	97,581,710.02	0.36%	148.59%
固定资产	994,816,129.84	4.23%	311,626,372.53	1.16%	219.23%
在建工程	-	-	648,318,365.22	2.41%	-100.00%
无形资产	30,324,614.79	0.13%	33,754,351.52	0.13%	-10.16%
商誉	5,845,161.39	0.02%	5,845,161.39	0.02%	0.00%
递延所得税资产	42,207,068.97	0.18%	56,759,228.86	0.21%	-25.64%
其他资产	53,493,570.67	0.23%	39,627,969.58	0.15%	34.99%
应付短期融资款	1,653,910,000.00	7.04%	-	-	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	-	57,720,060.00	0.21%	-100.00%
衍生金融负债	1,051,600.00	0.00%	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,859,381,144.71	12.17%	2,621,608,266.12	9.76%	9.07%
代理买卖证券款	7,052,225,490.04	30.01%	9,358,238,245.28	34.84%	-24.64%
代理承销证券款	953,688.33	0.00%	108,297.15	0.00%	780.62%
应付职工薪酬	161,237,337.15	0.69%	209,056,639.37	0.78%	-22.87%
应交税费	84,059,186.80	0.36%	107,668,830.59	0.40%	-21.93%
应付款项	7,033,953.89	0.03%	7,401,869.37	0.03%	-4.97%
应付利息	66,306,015.98	0.28%	158,183,552.16	0.59%	-58.08%
预计负债	541,766.60	0.00%	13,008,420.00	0.05%	-95.84%
应付债券	1,697,179,834.23	7.22%	4,200,000,000.00	15.64%	-59.59%
递延所得税负债	7,315,431.46	0.03%	12,946,930.48	0.05%	-43.50%
其他负债	510,096,731.63	2.17%	832,384,174.74	3.10%	-38.72%

#### 资产负债项目重大变动原因：

报告期末，公司资产总额 2,350,154.69 万元，同比减少 335,682.10 万元，下降 12.50%，其中，货币资金、递延所得税资产、应收款项、结算备付金、存出保证金等项目的降幅较大。扣除代理买卖证券款后，公司自有资产总额 1,644,932.15 万元，同比减少 105,080.83 万元，下降 6.00%。公司负债总额 1,410,129.22 万元，同比减少 347,703.31 万元，下降 19.78%，主要是以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、代理买卖证券款、预计负债、应付债券、应付利息、递延所得税负债的降幅较大。扣除代理买卖证券款后，公司自有负债总额 704,906.67 万元，同比减少 117,102.03 万元，下降 14.25%。资产负债率 42.85%（扣除代理买卖证券款），较上一年减少 4.12 个百分点，公司具备持续经营的稳定性及安全性。负债对公司现金流的影响主要表现在，债务偿还致筹资活动现金流出 351,610.00 万元；代理买卖证券款变动致经营活动现金流出 230,601.28 万元。变动幅度较大的资产负债表科目如下：



1、长期股权投资：报告期末为 24,257.50 万元，较期初增长 148.59%，系本期投资设立两家有限合伙基金、对参股公司增资及权益法核算被投资单位富安达经营效益增加。

2、固定资产：报告期末为 99,481.61 万元，较期初增长 219.23%，系办公大楼达到可使用状态，由在建工程转入固定资产。

3、在建工程：报告期末为 0，较期初减少 64,831.84 万元，系办公大楼达到可使用状态，转入固定资产。

4、其他资产：报告期末为 5,349.36 万元，较期初增长 34.99%，主要系本期预付上市费用及长期待摊费用中装修费支出增加。

5、应付短期融资款：报告期末为 165,391.00 万元，系本期发行收益凭证。

6、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：报告期末为 0，较期初减少 5,772.01 万元，系本期到期清偿以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7、衍生金融负债：报告期末为 105.16 万元，系期末持有的商品期权。

8、代理承销证券款：报告期末为 95.37 万元，较期初增长 780.62%，系期末应付客户基金赎回款增加所致。

9、应付利息：报告期末为 6,630.60 万元，较期初下降 58.08%，系本期兑付到期公司债和次级债并偿还应付利息。

10、预计负债：报告期末为 54.18 万元，较期初下降 95.84%，系本期支付前期计提的诉讼预计损失。

11、应付债券：报告期末为 169,717.98 万元，较期初下降 59.59%，系本期偿还到期公司债和次级债。

12、递延所得税负债：报告期末为 731.54 万元，较期初下降 43.50%，系期末金融资产公允价值变动时间性差异金额减少。

13、其他负债：报告期末为 51,009.67 万元，较期初下降 38.72%，系纳入合并范围结构化主体清偿优先级份额。

## 2. 营业情况分析

### (1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例
	金额	占营业收入的比重	金额	占营业收入的比重	
一、营业收入	1,384,562,680.80	-	1,499,611,313.01	-	-7.67%
手续费及佣金净收入	646,690,825.87	46.71%	1,015,800,768.29	67.74%	-36.34%
利息净收入	448,592,200.42	32.40%	311,222,099.44	20.75%	44.14%
投资收益	250,117,596.43	18.06%	279,954,774.98	18.67%	-10.66%





公允价值变动收益	32,776,867.02	2.37%	-123,132,828.95	-8.21%	126.62%
汇兑收益	-1,882,698.01	-0.14%	1,959,235.53	0.13%	-196.09%
其他业务收入	5,808,527.37	0.42%	6,509,086.62	0.43%	-10.76%
二、营业成本	844,846,765.75	61.02%	855,967,977.08	57.08%	-1.30%
税金及附加	16,201,030.60	1.17%	45,128,833.96	3.01%	-64.10%
业务及管理费	823,177,639.46	59.45%	811,596,596.46	54.12%	1.43%
其他业务成本					
资产减值损失	5,468,095.69	0.39%	-757,453.34	-0.05%	821.91%
续（营业收入）：					
资产处置收益	69,361.70	0.01%	7,298,177.10	0.49%	-99.05%
其他收益	2,390,000.00	0.17%	0.00	0.00%	-

**项目重大变动原因：**

1、手续费及佣金净收入较上年下降 36.34%，一是股票市场交易量和佣金率下降，经纪业务手续费净收入同比下降 28.03%；二是投资银行业务部分储备项目尚未完成，债券发行市场低迷，导致投资银行业务手续费及佣金净收入同比下降 65.21%。

2、利息净收入较上年增长 44.14%，主要系本期偿还到期公司债和次级债，致使本期计提利息支出金额降低，利息净收入增长。

3、资产处置收益较上年下降 99.05%，主要系公司 2016 年度处置一处办公房产，扣除相关税费后公司列入资产处置收益 718.49 万元。

4、公允价值变动收益较上年增长 126.62%，主要系市场行情变化，本期持仓的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值上升所致。

5、汇兑收益较上年下降 196.09%，主要系人民币升值，公司持有的美元及港币外币汇率下降所致。

6、其他收益 系新增会计报表列报项目，根据财政部于 2017 年 5 月 10 日颁布的财会[2017]15 号《关于印发修订〈企业会计准则第 16 号—政府补助〉的通知》文件调整的相关政府补助。

7、税金及附加较上年下降 64.1%，一是营业收入规模同比下降，致税金及附加减少；二是公司营改增自 2016 年 5 月执行，致 2017 年税金及附加同比相应减少。

8、资产减值损失较上年增长 821.91%，主要系公司 股票质押式回购业务规模上升，相应减值准备增加。

**(2) 收入构成：**

经纪业务方面。根据沪深交易所数据，2017 年两市股票基金成交额 122.61 万亿元，同比下降约 11.73%。面对交易量下降和佣金率下滑的不利环境，公司积极推动业务转型，加大营销力度和广度，加强客户数据挖掘，建立完善以客户需求为中心的服务模式，提升投资顾问服务水平，深耕传统通道业务；继续加强代销金融产品库建设，为客户提供适当产品；



与其他业务条线加强协同,积极拓展中间业务和机构业务,扩大收入来源,优化业务结构。2017年,公司代理买卖股票基金交易量 13,375.99 亿元,市场占有率 1.09%。根据中国证券业协会统计的证券公司经营数据(未经审计),2017年公司证券经纪业务净收入行业排名 49 位。受不利市场环境等因素影响,公司证券经纪业务 2017 年实现营业收入 5.68 亿元,同比下降 26.84%。报告期内,公司代理销售金融产品的情况如下:

单位:元

代销金融产品 类别	2017 年度		2016 年度	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	1,199,887,284.32	14,437,905.24	1,356,243,759.13	11,200,346.06
其他	29,870,488,125.01	1,096,267.93	30,595,820,536.02	1,814,519.99
合计	31,070,375,409.33	15,534,173.17	31,952,064,295.15	13,014,866.05

证券自营业务方面。2017 年,股票市场指数整体震荡走升,但市场分化明显,上证 50 和沪深 300 指数全年涨幅分别高达 25.02%、21.78%,以创业板指数、中证 1000 指数为代表的中小市值股票则走势低迷;债券二级市场收益率震荡上行,债券现券交易量 108.4 万亿元,同比下降 18.0%。公司自营相关部门严格控制风险,股票市场方面,注重行业配置,优选价值成长品种,较好地把握住结构性投资机会,债券市场方面,确立以稳健为主的投资交易策略,控制并适时调整投资规模杠杆和持仓品种久期,业绩稳定。根据中国证券业协会统计的证券公司经营数据(未经审计),2017 年公司证券投资收益行业排名 72 位。公司证券自营业务 2017 年实现营业收入 2.39 亿元,同比增长 134.94%。

投资银行业务方面。2017 年 A 股首发上市融资额 2,301.09 亿元,较上年增长 53.81%。债券市场共发行各类债券 40.8 万亿元,比上年增长 12.9%。公司积极推动投行业务与其他业务的协同,拓展项目和积累客户资源,开拓业务机会。股票融资方面,作为联席主承销商完成 1 单非公开发行优先股项目,担任(联席)保荐机构(主承销商)的 2 单非公开发行股票项目过会,1 单重大资产重组项目过会;债券及资产证券化方面,作为主承销商完成 7 个债券发行项目,2 只公司债项目获得批复,作为财务顾问协助完成 1 单资产支持专项计划的设立;新三板业务方面,推荐 7 家企业挂牌新三板,协助 16 家挂牌公司进行定向融资。根据中国证券业协会统计的证券公司经营数据(未经审计),2017 年公司担任股票和债券主承销商的项目数量行业排名分别为 62 位和 63 位。公司投资银行业务 2017 年实现营业收入 8,972.35 万元,同比下降 65.06 %。

资产管理业务方面。报告期内,监管部门持续加强对资产管理业务的监管。在降杠杆、强监管的市场环境下,证券公司资产管理业务规模较上年同期有所下降。根据中国证券投资基金业协会数据,截至 2017 年 12 月末,证券公司资产管理业务管理资产规模 16.54 万亿元,较 2016 年末下降 5.92%。公司资产管理业务积极向主动管理转型,加强银行等机构客户的拓展,管理资产规模维持稳定。根据中国证券业协会统计的证券公司经营数据(未经审计),





报告期末公司受托资金规模行业排名 68 位。报告期末,公司(含子公司)管理和运作的集合资产管理计划合计 5 只,定向资产管理计划合计 25 只,按合并口径计算,资产管理业务期末受托资金合计 399.88 亿元,同比增长 13.50%。因市场行情及收费方式调整等因素影响,定向资产管理业务的管理费收入和业绩报酬有所下降。公司资产管理业务 2016 年实现营业收入 8,026.63 万元,同比下降 22.73%。

信用交易业务方面。根据沪深交易所数据,截至 2017 年末,两市融资融券业务余额 10,262.64 亿元,较 2016 年末增长 9.26%。报告期内,公司完善信用交易业务决策机制,谨慎确定业务规模,优化业务流程,认真落实客户适当性管理要求,全面加强风险监控和管理,防范业务风险。报告期末,公司融资融券业务余额 55.89 亿元,较 2016 年末增长 0.96%;股票质押式回购交易业务余额 22.84 亿元,较 2016 年末增长 159.48%。根据中国证券业协会统计的证券公司经营数据(未经审计),报告期公司融资业务利息收入行业排名 49 位。公司信用交易业务 2017 年实现营业收入 4.98 亿元,同比增长 12.77%。

期货经纪业务方面。根据中国期货业协会数据,报告期内全国期货市场累计成交额为 1,878,964.10 亿元,同比下降 3.95%。南证期货加强业务拓展,积极落实客户适当性管理,提升客户服务水平;加强资金管理,提高资金使用效率;加强人才引进和培训,强化业务团队建设。受市场行情等因素影响,2017 年公司期货经纪业务实现营业收入 5,321.93 万元,同比下降 3.66%。

公司总部及其他业务。2017 年该分部营业收入为-10,233.69 万元,主要为支付到期公司债和次级债支付的利息,由于负债金额下降,致使计提利息支出金额相应降低。

#### 按业务分类分析:

单位:元

项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
证券经纪业务	568,442,527.11	41.06%	776,949,540.32	51.81%
资产管理业务	80,266,333.01	5.80%	103,884,241.59	6.93%
证券投资业务				
证券承销业务				
财务顾问业务				
证券自营业务	238,763,347.09	17.24%	101,629,417.65	6.78%
投资银行业务	89,723,516.54	6.48%	256,799,633.00	17.12%
信用交易业务	498,357,660.41	35.99%	441,917,534.90	29.47%
公司总部及其他业务	-102,336,878.66	-7.39%	-208,050,635.87	-13.87%
期货经纪业务	53,219,285.73	3.84%	55,241,636.10	3.68%
分部间相互抵消	-41,873,110.43	-3.02%	-28,760,054.68	-1.92%
合计	1,384,562,680.80	-	1,499,611,313.01	-

#### 按区域分类分析:



√适用 □不适用

单位：元

类别/项目	本期收入金额	占营业收入比例%	上期收入金额	占营业收入比例%
江苏地区	1,162,618,852.51	83.97%	1,168,703,628.53	77.93%
宁夏地区	132,033,182.02	9.54%	181,885,371.26	12.13%
上海地区	33,323,206.25	2.41%	43,005,066.75	2.87%
广东地区	21,339,209.09	1.54%	26,880,991.48	1.79%
云南地区	19,107,602.16	1.38%	25,724,685.78	1.72%
北京地区	9,984,802.55	0.72%	14,787,341.03	0.99%
其他地区	48,028,936.65	3.47%	67,384,282.86	4.49%
分部间相互抵消	-41,873,110.43	-3.02%	-28,760,054.68	-1.92%

**收入构成变动的原因：**

报告期内，主营业务占比、按业务 或区域进行分类的收入占营业收入的比例无增减达到或超过 30%的情况。

**(3) 营业成本构成**

单位：元

项目	本期成本金额	上期成本金额
证券经纪业务	419,405,992.54	428,229,736.09
资产管理业务	28,944,740.97	42,829,060.67
证券投资业务		
证券承销业务		
财务顾问业务		
证券自营业务	48,643,884.00	90,194,716.29
投资银行业务	71,218,963.64	104,010,652.07
信用交易业务	12,505,684.44	19,327,517.67
期货经纪业务	41,843,588.51	43,007,985.54
公司总部及其他业务	226,033,822.18	133,524,123.40
分部间相互抵消	-3,749,910.53	-5,155,814.65

**营业成本构成变动的原因：**

公司营业支出占比较大的项目为业务及管理费、税金及附加。2017 年营业支出为 84,484.68 万元，较上年减少 1,112.12 万元，下降 1.30%。

1、报告期信用交易业务营业支出为 1,250.57 万元，较上年下降 35.30%，主要系 2016 年 5 月后实施营改增，由原来缴纳价外税变成缴纳价内税，税金及附加有所减少。

2、报告期证券自营、投资银行及资产管理业务营业支出分别为 4,864.39 万元、7,121.90 万元、2,894.47 万元，较上年分别下降 46.07%、31.53%、32.42%，主要系报告期内相关业务条线职工薪酬有所减少。



3、报告期公司总部及其他业务营业支出为 22,603.38 万元,较上年增加 9,250.97 万元,增长 69.28%,主要系 2017 年公司搬入新大楼引起的折旧、物业费增加,以及因人员数量增加导致人力成本增加。

### 3. 现金流量状况

单位: 元

项目	本期金额	上期金额	变动比例
经营活动产生的现金流量净额	-1,056,716,132.59	-3,097,455,541.18	65.88%
投资活动产生的现金流量净额	-201,257,161.24	-182,070,848.31	-10.54%
筹资活动产生的现金流量净额	-1,738,163,744.91	-2,414,448,046.47	28.01%

#### 现金流量分析:

报告期内经营活动产生的现金流量净额为-10.57 亿元,同比上升 65.88%。其中:经营活动现金流出 37.63 亿元,较上年减少 103.68 亿元,同时现金流入较上年减少 83.27 亿元。主要是:(1) 2017 年证券市场维持震荡格局,市场交易活跃度下降,代理买卖证券支付的现金净流出 23.06 亿元,上年为净流出 49.80 亿元,同比减少 26.74 亿元;同时,利息、手续费及佣金现金净流入 15.63 亿元,上年为净流入 21.15 亿元,同比减少 5.52 亿元;(2) 受市场影响,缩减逆回购规模,全年回购业务资金净流入 4.78 亿元,上年为净流出 69.16 亿元;(3) 自营业务规模下降,处置金融资产现金净流入 2.39 亿元,上年为净流入 60.51 亿元,同比减少 58.12 亿元。

报告期经营活动产生的现金流量净额与净利润的差异情况说明如下:

项目	金额(万元)	说明
经营活动产生的现金流量净额	-105,671.61	
净利润	41,221.16	
经营活动产生的现金流量净额与净利润的差异	-146,892.77	本项金额与其中项合计的尾差为四舍五入原因所致
其中: 资产减值准备	546.81	主要系本年股票质押式回购余额大幅增加,计提的减值准备相应增加
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	5,978.23	主要系计提的房屋及建筑物、电子设备及办公设备折旧
无形资产摊销	1,577.06	主要系计提的软件使用权摊销
长期待摊费用摊销	427.54	主要系计提的装修费摊销
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	-6.94	本年处置固定资产产生的损益
固定资产报废损失	56.46	本年报废固定资产产生的损失
公允价值变动损失	-3,302.15	持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产市场价格上升产生浮盈
利息支出	18,275.54	公司发行固定收益凭证、次级债、公司债及合并结构化主体优先级份额的利息支出
投资损失	-1,152.65	按持股比例享有的富安达基金等参股公司的投资损益份额
递延所得税资产减少	1,782.90	主要系职工薪酬可抵扣暂时性差异金额减少
递延所得税负债增加	469.71	主要系公司持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产市场价格上升,应纳税暂时性差异增加



以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产净减少	27,752.32	债券市场震荡下跌,信用风险加大,公司降低以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产债券持仓规模
可供出售金融资产净减少	-2,494.16	2017年4季度债券收益率快速上行,公司增持高信用、高评级的债券拟长期持有
经营性应收项目的减少	24,952.76	主要系2017年下半年以来融资融券业务回暖,融出资金规模有所上升,致融出资金增加0.53亿元;债券市场震荡下跌,公司缩减债券逆回购业务规模致买入返售金融资产减少2.40亿元;期末期货业务保证金减少,致存出保证金减少0.64亿元
经营性应付项目的增加	-221,756.21	主要系证券市场呈分化走势,两市交易量同比下降,投资者活跃程度下降,致代理买卖证券款减少23.06亿元;因业务发展需要,两融收益权转让融资增加,致卖出回购金融资产款增加2.38亿元;本年到期清偿以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,致以公允价值计量且变动计入当期损益金融负债减少0.56亿元

#### (四) 投资状况分析

##### 1. 主要控股子公司、参股公司情况

报告期内,无来源于单个子公司的净利润或单个参股公司的投资收益对公司净利润影响达10%以上的情况。2017年,公司全资子公司南证期货和巨石创投分别实现净利润825万元、817.47万元,控股子公司宁夏股权交易中心实现净利润329.08万元。公司持有富安达基金49%股权,系其第一大股东。富安达基金主要从事基金管理业务,2017年营业收入13,419.71万元,净利润2,345.98万元。

报告期内,南证期货启动增资扩股,决定将注册资本由12,575万元增至15,797万元,增加的3,222万元出资额由紫金集团全部认缴。本次增资完成后,公司持有南证期货79.60%股权,紫金集团持有南证期货20.40%股权。2018年2月2日,江苏证监局出具《关于核准南证期货有限责任公司变更股权的批复》(苏证监许可字〔2018〕3号),对南证期货本次增资及股权变动予以核准。截至本报告签署日,上述增资及股权变动的工商变更登记手续尚未办理完毕。

报告期内,因监管政策变化,巨石创投决定按法定程序解散和注销其控股子公司南京巨石金川股权投资基金管理有限公司及宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司,截至报告期末,上述两家公司的注销程序尚未完成。

##### 2. 委托理财及衍生品投资情况

公司具有证券自营业务资格,可以按规定从事金融衍生品等品种的投资和交易。为保证资金流动性需要,提高资金使用效率和收益,公司使用部分自有流动性资金用于购买银行保本型或低风险的理财产品,2017年公司购买银行理财产品的日均余额为8.09亿元。截至报告期末公司衍生品投资情况详见本报告所附财务报表附注六(五)衍生金融工具。

报告期内,公司无委托贷款情况。



### 3. 公司控制的特殊目的主体情况

公司考虑本公司所享有的结构化主体可变回报,以及所承担的敞口风险等因素,将拥有控制权的特殊目的主体纳入合并范围。报告期末,纳入公司合并报表范围的特殊目的主体合计 3 个,包括南京证券神州 4 号股票精选集合资产管理计划、宝通 2 号集合资金信托计划及富安达-南证量化 1 号资产管理计划。报告期内公司设立和处置特殊目的主体的情况详见本节“二、经营情况回顾”之“(七)合并报表范围的变化情况”。

### 4. 业务创新情况

无

### 5. 融资渠道和融资能力

(1) 主要融资渠道和融资能力。公司经营规范、信用良好,有较强的短期和中长期融资能力。公司与商业银行、证金公司、基金公司等金融机构保持良好的合作关系,能够通过监管许可的融资方式,筹集经营所需资金。报告期内,公司主要融资渠道包括同业拆借、债券回购、转融资、融资融券收益权转让、发行公司债、发行次级债、发行收益凭证等。此外,公司还可以根据市场环境和自身需求,通过增发股份及主管部门批准的其它方式进行融资。公司的资金筹集渠道较为多元,能够保障各项业务正常经营的资金需求。

(2) 负债结构。报告期末,公司资产负债率(扣除代理买卖证券款)为 42.85%,合并报表总负债 141.01 亿元,扣除代理买卖证券款 70.52 亿元后,自有负债 70.49 亿元。其中短期负债 53.44 亿元,占自有负债的比例为 75.81%,主要为应付短期融资款、卖出回购金融资产款、其他负债等;长期负债 17.05 亿元,占自有负债的比例为 24.19%,主要为应付债券等。公司短期负债余额同比增加 13.50 亿元,增幅 33.8%,主要为应付短期融资款增加 16.54 亿元。公司长期负债余额同比减少 25.21 亿元,降幅 59.65%,主要为公司债、次级债到期归还,应付债券减少 25.03 亿元。2017 年 10 月,公司向合格投资者公开发行公司债券 10 亿元,发行后长期负债比重有所回升。报告期内公司各项风控指标均未触及预警标准,具备持续经营的稳定性及安全性。

(3) 维持流动性水平所采取的措施和相关的管理政策。公司建立了流动性风险管理制度体系,明确了各部门职责及协同机制,严格执行流动性风险识别、计量、监测、控制等管理措施,防范和管理流动性风险。具体措施包括:统一资金管理。计划财务部是资金管理部门,资金管理遵循集中管理、统一调度、合理计划、合规使用的原则;统一融资管理,积极拓展融资工具和渠道,加强渠道维护,提高融资来源的多元化和稳定性;建立现金流测算和分析框架,结合资金计划开展现金流预测,实施日间管理,合理安排资金需求,确保公司具备充足的流动性头寸和相关融资安排;在公司制定的包括流动性风险偏好在内的风险偏好框架下,建立分层级的优质流动性资产管理体系,持有充足的优质流动性资产,并对其进行监





控;在满足公司流动性需求、资金高流动性、高安全性的前提下,进行流动性组合投资;基于流动性风险监管、内部流动性风险管理要求及发展策略,建立流动性风险限额体系,并在流动性风险管理过程中实施监测与控制;建立有效的流动性风险报告机制,每日向财务总监、首席风险官报告资金头寸日报、流动性风险状况,确保管理层及时了解流动性风险水平及其管理状况;定期开展流动性压力测试,并制定相应流动性管理策略;针对内外部流动性风险事件,明确应急处置原则、程序、措施,制定流动性风险应急计划,及时进行相应处置。

(4)或有事项及其对财务状况的影响。报告期末,公司或有事项主要为未决诉讼或仲裁形成的或有事项。上述事项已经计提预计负债,对公司财务状况的影响较小。

## (五) 审计情况

### 1. 非标准审计意见说明:

适用 不适用

### 2. 关键审计事项说明:

适用 不适用

## (六) 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

适用 不适用

会计政策变更情况如下:

1、本期本公司执行的《企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》

财政部于 2017 年 4 月 28 日颁布《财政部关于印发<企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营>的通知》文件,要求自 2017 年 5 月 28 日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行。

(1) 变更前本公司执行的持有待售的非流动资产、处置组和终止经营会计政策

本次会计政策变更前,本公司执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《财政部关于印发<企业会计准则第 1 号—存货>等 38 项具体准则的通知》、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关文件中涉及持有待售的非流动资产、处置组和终止经营相关规定。

(2) 持有待售的非流动资产、处置组和终止经营会计政策变更情况

本次会计政策变更后,本公司执行财政部于 2017 年 4 月 28 日颁布的《企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》相关规定,并于 2017 年 5 月 28 日采用未来适用法处理相关事项。变更后会计政策详见附注三-(三十五)。

(3) 本次会计政策变更对公司未产生影响。

2、本期本公司执行的《企业会计准则第 16 号—政府补助》

财政部于 2017 年 5 月 10 日颁布《关于印发修订<企业会计准则第 16 号—政府补助>的通知》,并要求自 2017 年 6 月 12 日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行。



## (1) 变更前公司执行的政府补助会计政策

本次会计政策变更前,本公司执行财政部于2006年2月15日颁布的《财政部关于印发<企业会计准则第1号—存货>等38项具体准则的通知》中的《企业会计准则第16号—政府补助》、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定。

## (2) 政府补助会计政策变更情况

根据财政部新修订的政府补助会计准则,与企业日常活动相关的政府补助,按照经济业务实质计入其他收益或冲减相关成本费用,并在利润表中单独列报“其他收益”项目,列示计入其他收益的政府补助项目;与企业日常活动无关的政府补助,计入营业外收支。该准则自2017年6月12日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行,并自2017年1月1日发生的政府补助采用未来适用法处理,对2017年1月1日至该准则施行日之间新增的政府补助根据该准则进行调整。

## (3) 本次会计政策变更对公司的影响

项目	2017年度
其他收益	2,390,000.00
营业外收入	-2,390,000.00

## 3、本期本公司执行的财会(2017)30号《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》

财政部于2017年12月25日发布了《财政部关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》文件,对一般企业财务报表格式进行了修订,对本公司报告期财务报表的影响情况如下:

## (1) 合并财务报表

会计政策变更的内容	受影响的合并报表项目		
	期间	名称	金额(单位:元)
(1) 在合并利润表中分别列示“持续经营净利润”和“终止经营净利润”。比较数据相应调整。	2016年	持续经营净利润	493,719,756.21
	2017年	持续经营净利润	412,211,555.24
(2) 在合并利润表中新增“资产处置收益”项目,将部分原列示为“营业外收入”的资产处置损益重分类至“资产处置收益”项目。比较数据相应调整。	2016年	营业外收入	-7,298,177.10
		资产处置收益	7,298,177.10
	2017年	营业外支出	-7,816.68
		营业外收入	-77,178.38
		资产处置收益	69,361.70

## (2) 母公司财务报表

会计政策变更的内容	受影响的报表项目		
	期间	名称	金额(单位:元)
(1) 在利润表中分别列示“持续经营净利润”和“终止经营净利润”。比较数据相应调整。	2016年	持续经营净利润	532,757,688.88
	2017年	持续经营净利润	408,559,347.66
(2) 在利润表中新增“资产处置收益”项目,将部分原列示为“营业外收入”的资产处置损益重分类至“资产处置收益”项目。比较数据相应调整。	2016年	营业外收入	-7,298,177.10
		资产处置收益	7,298,177.10
	2017年	营业外支出	-7,726.17
		营业外收入	-51,472.41
		资产处置收益	43,746.24



## (七) 合并报表范围的变化情况

√适用 □不适用

报告期内，公司合并报表范围变化情况如下：

子公司/特殊目的主体名称	2017年12月31日	2016年12月31日
南京巨石创业投资有限公司	合并	合并
南京巨石金川股权投资基金管理有限公司	合并	合并
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	合并	合并
南证期货有限责任公司	合并	合并
宁夏股权托管交易中心（有限公司）	合并	合并
南京证券神州4号股票精选集合资产管理计划	合并	合并
北信利通债券投资集合资金信托第2期投资组合	/	合并
龙兴506号定向资产管理计划	/	合并
尚书1号定向资产管理计划	/	合并
宝通3号集合资金信托计划	/	合并
宝通2号集合资金信托计划	合并	合并
富安达-南证量化1号资产管理计划	合并	/

注1：2017年度通过设立或者投资等方式新纳入合并范围的结构化主体

2017年5月本公司以自有资金认购“富安达-南证量化1号”资产管理计划全部份额，根据合同约定享有其全部收益及承担其全部风险。综合考虑本公司所享有的结构化主体可变回报及所承担的敞口风险等因素，将本公司认定具有控制权的上述结构化主体纳入合并范围。

2017年2月本公司与南京银行股份有限公司签订《第一创业证券股票质押40号定向资产管理计划收益权转让合同》，本公司受让南京银行股份有限公司在《第一创业证券股票质押40号定向资产管理合同》项下全部收益权及其他所有的权利和承担的义务，成为《第一创业证券股票质押40号定向资产管理合同》唯一受益人。综合考虑本公司所享有的结构化主体可变回报，以及所承担的敞口风险等因素，将本公司认定具有控制权的上述结构化主体纳入合并范围。

注2：2017年度通过处置等方式不再纳入合并范围的结构化主体

2017年6月本公司与江阴华中投资管理有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》，江阴华中投资管理有限公司受让本公司在《第一创业证券股票质押40号定向资产管理合同》项下全部收益权及其他所有的权利和承担的义务，成为《第一创业证券股票质押40号定向资产管理合同》唯一受益人。期末本公司不再将上述结构化主体纳入合并范围。

本公司本期收回“北信利通债券投资集合资金信托”第2期投资组合和龙兴506号定向资产管理计划所认购全部份额及其收益，期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利，本期不再将其纳入合并范围。





本公司本期收回“宝通 3 号”集合资金信托计划所认购全部份额及其收益, 期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利, 本期不再将其纳入合并范围。

本公司本期收回“尚书 1 号”定向资产管理计划所认购全部份额及其收益, 期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利, 本期不再将其纳入合并范围。

## (八) 企业社会责任

报告期内, 公司积极开展扶贫和帮扶工作, 回馈社会, 依法保护债权人、员工、客户等利益相关方的合法权益。

1、扎实做好“一司一县”扶贫工作。公司与宁夏回族自治区同心县密切协作, 努力打好精准扶贫“组合拳”。发挥中介优势, 帮助引进数家优质企业在地注册投资, 并通过助推企业融资, 推动当地葡萄酒及旅游产业发展。同时, 公司还想方设法多渠道助力当地农产品销售。2017 年 2 月, 中证互联股份有限公司授予公司消费扶贫“最佳推广奖”; 在同心县设立金融扶贫工作站暨证券营业部, 利用金融专业优势, 开展专场培训、融资对接等活动, 引导当地企业利用资本市场解决融资困难, 帮助当地增强自我发展能力; 与同心县开展三级党组织联创共建活动, 积极帮扶当地困难群众, 全年向同心县捐赠资金 400 余万元。

2、主动作为, 全面做好各类帮扶工作。2017 年, 公司与江苏省淮安市涟水县朱码镇花桥村开展了“城乡结对、文明共建”活动, 在共建基础设施、共培文明新风等方面开展共建活动。公司共投入 30 万元, 助推美丽乡村建设和农村精神文明建设。公司与南京市江宁区横溪街道横山社区开展脱贫攻坚结对帮扶活动, 走访慰问 81 户困难群众, 有针对性地开展结对帮扶, 给予困难群众物质和资金帮扶共计 15 万元。同时开展产业帮扶, 公司捐助帮扶资金 20 万元帮助横山社区推进竹塘坝种植产业项目, 推动社区实现自我“造血”式脱贫; 公司积极响应中国证券业协会号召, 向山西省隰县午城镇寺坡村扶贫电站建设项目捐赠建设资金 75 万元。

3、依法保护客户、职工和投资者利益。公司注重保护客户利益, 根据规定缴纳投资者保护基金, 全面落实投资者适当性管理相关监管要求, 通过多种方式积极开展投资者教育, 引导投资者理性投资, 努力提升客户服务质量和水平, 切实保护客户合法权益; 公司始终重视职工利益。公司坚持依法合规用工, 保障员工合法权益, 劳动关系和谐。积极推动人才队伍和梯队建设, 为优秀人才成长提供发展空间。为员工提供多种福利, 并通过开展形式多样的文体活动和集体活动, 提升员工的凝聚力和向心力, 构建起和谐的企业文化; 公司注重股东和债权人利益保护。持续完善公司治理, 保障股东权利。坚持稳健经营, 为股东提供合理回报, 同时, 认真执行各项偿债保障措施, 报告期内公司所发行相关债券本息均按时足额兑付, 有效地保护了债券持有人权益。



### 三、 持续经营评价

报告期内,公司法人治理结构完善,内部控制机制健全有效,管理层专业稳定,公司各项业务经营情况未发生或面临重大变化。公司的经营状况稳健,营业收入、营业利润等财务指标正常。截至本报告签署日,不存在可能对公司未来持续经营发生重大影响的事项或情况。

### 四、 未来展望

适用 不适用

### 五、 风险因素

#### (一) 持续到本年度的风险因素

报告期内,公司依照监管部门和行业协会全面风险管理规范要求,不断加强日常风险监控,建立了适应公司稳健规范发展要求的全面风险管理体系,确保对公司各类业务风险的识别和控制,为公司可持续发展提供保证。根据监管部门要求,公司设立了首席风险官,建立了适应现代创新发展要求的全面风险管理组织架构。该架构由五个层级构成,分别为:公司董事会及其下设的合规与风险管理委员会;总裁室及其下设的风险控制委员会;首席风险官;风险管理部、合规管理部、计划财务部、稽核部门、办公室等后台管理部门;各业务部门、分支机构及其内设风控合规专员,子公司及其风险管理负责人。首席风险官负责推动公司全面风险管理工作,指导、协调风险管理部及相关后台职能管理部门、业务部门和分支机构及子公司的风险管理工作,组织实施对公司各项业务及整体所面临各类风险的监测、评估、管理、控制与报告工作,为公司董事会、经营管理层战略发展与业务决策提供风险管理建议和意见,指导、督促和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。公司确立了风险管理的三道防线:各部门、分支机构及子公司实施有效的风险管理自我控制为第一道防线;风险管理部门实施专业的风险管理工作为第二道防线;稽核部门实施事后监督与评价为第三道防线。

#### 1、市场风险分析及其对策

公司面临的市场风险是公司的持仓组合由于相关市场的不利变化而导致损失的风险。公司的市场风险主要源于权益类投资、固定收益类投资、衍生品投资等,主要集中于公司投资管理总部、固定收益总部和资产管理总部等业务部门。目前,公司主要从风险评估、投资决策、流程控制、风险隔离四个方面来控制公司的市场风险:

(1) 风险评估。公司采取敏感性分析和压力测试等方式,定期或不定期对公司的市场风险承受能力进行测试,确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。公司建立了市场风险管理体系,对收益率曲线风险、期权性风险、股票价格风险等市场风险进行有效识别。

(2) 投资决策。公司分别设立证券投资决策委员会、固定收益投资决策委员会和资产



管理业务投资决策委员会，各投资决策委员会对公司总裁室负责，负责制定公司业务投资策略，确定证券投资持仓比例及资产配置方案等。

(3) 流程控制。公司采取规模控制、授权管理和止盈止损控制等措施来控制市场风险：董事会每年根据风险评估的结果确定自营等业务规模，确保在风险可承受范围内开展业务；董事会对投资决策委员会、投资业务部门按照投资规模、投资范围分级授权，并且在投资策略、投资具体品种的决策方面相分离，确保业务各环节的有效制衡；通过止盈止损控制单项投资的风险，避免单项投资亏损过大情况的出现，通过设定总的风险容忍度规避系统性市场风险。

(4) 风险隔离。公司通过建立隔离墙制度，对各项业务实施人员、信息、物理、财务、账户等方面的隔离，防止某项业务的市场风险蔓延到公司其他业务模块，防止利益冲突或不正当利益输送。

此外，公司风险管理部通过考虑各类业务投资的风险收益情况，制定了各类业务的风险限额、风险容忍度系列指标，使用专业风险管理工具对各类业务的市场风险状况进行独立的监控、测量和管理。当发生接近或超过风险限额情况时，风险管理部及时向相关部门及领导发送预警或风险提示，协助并监督业务部门实施应对措施。

## 2、信用风险分析及其对策

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约或履约能力下降而为公司带来损失的风险。公司的信用风险主要来自融资融券类业务、股票质押回购交易、约定式购回交易、经纪业务代理客户买卖证券、固定收益投资、合同履行等方面。公司主要采取加强客户征信管理、加强固定收益投资控制及强化合同管理等方式控制信用风险：

(1) 融资融券业务中，在加强客户征信管理的同时建立了单一客户授信额度、单一担保证券规模等业务信用风险限额，以及逆周期对客户融资保证金比例和担保证券折算率的动态调整机制，确保融资融券业务的稳健开展。

(2) 股票质押回购和约定式购回交易中，公司制定标准化的业务交易协议，明确交易双方的权利义务以及违约处理措施；建立对单一客户、单一证券交易规模的控制，对客户资信、担保品等进行审慎评估并动态管理，落实盯市和担保品追加机制，以有效规避业务信用风险。

(3) 经纪业务代理客户买卖证券中，公司建立证券交易实时监控系統，对客户异常交易行为、证券账户异常行为、新股上市初期异常交易行为等进行实时监控，对监控系统显示的实时预警指标和查询类指标，区分重要程度及时逐级妥善处理。

(4) 固定收益投资中，选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易对手进行交易，减少不良交易对手产生的风险；对债券发行人及其担保人的资产实力进行分析，跟踪研究发行人的偿债能力，规避兑付风险。

(5) 在合同订立过程中严格贯彻公司的有关制度，实行分级审批，加强法律和合规审



核,防止欺诈或不公平条款产生的合同风险。

### 3、流动性风险分析及其对策

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所需资金的风险。公司主要通过完善财务资金管理制度、建立净资本预警机制、动态监控等措施控制流动性风险:

(1) 建立健全以净资本为核心的风险控制指标预警机制,严格按照监管部门风险控制指标规定比例开展有关业务,确保风险控制指标及有关财务指标持续符合相关监管规定。

(2) 建立健全财务管理制度和资金管理制度,实行全面预算管理制度,健全财务指标考核体系;严格执行资金调拨、资金运用的授权审批制度,加强资金筹集的计划管理。

(3) 积极开展资金缺口管理,通过测算资金流量缺口,有效管理支付风险。

(4) 拓展多元化的融资渠道,避免由于融资渠道过于集中或融资方式过于单一而导致筹资困难。

(5) 建立流动性风险指标动态监控系统,实时监控,防范流动性风险。

### 4、业务操作风险分析及其对策

业务操作风险是指各项业务因经营模式选择不当或操作失误对公司造成的风险,如操作流程设计不当或矛盾,内部控制未落实等。业务操作风险涉及公司各项业务,包括经纪业务、自营业务、资产管理业务、投资银行业务等,公司主要通过下列措施控制操作风险:

(1) 建立并完善各项业务制度、操作流程和对应的业务表单,明确各业务的操作规范。

(2) 专门制定操作风险管理制度,对业务开展中各类操作风险的识别、评估、防范和控制作了明确规定和要求,进一步强化各类别操作风险的管理。

(3) 明确界定各部门、分支机构及不同工作岗位职责和权限,体现重要部门、关键岗位之间分离、制衡及相互监督的原则。

(4) 建立健全授权管理制度,明确授权的范围、方式、权限、时效和责任,并建立相应的授权反馈和修正机制,确保授权管理的有效落实。

(5) 做好创新业务风险的识别与控制,制度先行,规范业务操作流程。

(6) 建立内部控制管理学习培训体系,组织内控制度培训,加强员工职业道德教育。

## (二) 报告期内新增的风险因素

无

## 六、 动态风险控制指标监控及补足机制建立、达标情况

(一) 公司根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》及《证券公司压力测试指引》等相关规定,修订了《压力测试管理办法》、《风险



控制指标动态监控实施细则》、《风险控制指标动态监控系统有效性评估细则》等制度,建有风险控制指标动态监控技术系统,明确了风险控制指标监控、敏感性分析及压力测试等工作要求,并将相关工作嵌入业务合同审核、风险事项报告等流程,确保开展重大业务时,对风控指标的敏感性分析与压力测试落实到位,指导业务决策。

(二)公司指定专人对净资产等风控指标进行日常监控与报告;在开展证券承销、设立集合资产管理计划、股利分配、融资融券、重大对外投资等重大业务或经营行为时,进行风险控制指标的敏感性分析或压力测试,在测算分析基础之上提出业务规模或经营管理行为的调整建议,确保各项风险控制指标符合监管要求。在此基础上,公司定期对风险控制指标动态监控系统运行的有效性进行评估,确保风险控制指标动态监控机制运行平稳、有效。

(三)公司建立了净资产的补足机制。根据公司《风险控制指标动态监控实施细则》的有关规定,当与净资产、流动性相关的风险控制指标不符合规定标准,且无法通过业务调整方式使其符合规定的,公司将启动相应的资本补充机制,通过股权、债转股、发行次级债等融资方式,提升公司资本实力来确保相关风控指标的持续达标。

报告期内,公司未出现风控指标达到预警标准或不符合监管标准以及根据监管规定及公司制度规定需启动净资产补足机制的情形。

## 七、 注册资本、净资产、经营范围及各单项业务资格情况

(一)报告期末,母公司注册资本 2,473,999,503 元,净资产为 7,416,833,648.53 元,其中核心净资产 7,416,833,648.53 元。

(二)经营范围及单项业务资格情况,详见:“第二节 公司概况”之“七、公司经营范围和单项业务资格”。

## 八、 公司其他情况

### (一) 公司历史沿革

详见:“第二节 公司概况”之“八、公司历史沿革”。

### (二) 公司组织机构情况

详见:“第二节 公司概况”之“九、公司组织结构”。

### (三) 公司证券营业部的数量和分布情况

详见:“第二节 公司概况”之“十一、公司营业部数量和分布情况”。



**(四) 其他****1、账户规范管理情况**

公司严格执行账户管理的相关监管要求,制定完善账户管理等制度,加强对账户管理及规范工作的事前管理、事中监督及事后检查力度,强化开户业务复核机制,落实违规行为的处罚问责机制,建立健全账户规范管理的长效机制。截至 2017 年 12 月 31 日,公司剩余不合格证券账户为 334 户、司法冻结证券账户为 107 户,纯资金客户数为 9784 户、原西北证券风险处置遗留账户为 3629 户,剩余不合格证券账户占公司托管的全部客户证券账户总数的比例为 0.0171%。

**2、破产、重整、兼并、合并、分立以及重大资产收购、处置等事项**

报告期内,公司无破产、重整、兼并、合并或分立等事项。

**3、分支机构新设、迁址等情况**

(1) 报告期内,公司新设 2 家分支机构。

序号	分公司/营业部	地址	获得经营证券业务许可证时间
1	南京江东中路证券营业部	南京市建邺区江东中路 389 号	2017.03.20
2	武汉新华路证券营业部	武汉市江汉区新华路 139 号 凯盟大厦 3 楼 310 室	2017.09.06

(2) 报告期内,4 家分支机构发生迁址。

序号	迁址前名称	迁址后名称	新址	获得经营证券业务许可证时间
1	北京分公司	北京分公司	北京市朝阳区东三环南路 19 号院 1 号楼-2 至 15 层 101 内甲段四层 M08/M11/M15/M17/M10	2017.05.26
2	南京溧水中大街证券营业部	南京溧水 康利广场 证券营业部	南京市溧水区永阳镇致远路 68 号 康利华府 C 幢 105、106、107 室	2017.06.13
3	金坛东门大街证券营业部	金坛东环二路 证券营业部	常州市金坛区东环二路 206-1 号	2017.09.14
4	长沙韶山北路证券营业部	长沙湘府西路 证券营业部	长沙市天心区湘府西路 31 号 尚玺苑 20 栋 104、610 号	2017.09.25

**4、利润分配政策的制定、执行和调整情况**

2012 年 9 月 21 日,公司创立大会审议通过了《南京证券股份有限公司章程》。公司按照监管规定,在《公司章程》中对利润分配的决策程序和机制、分配利润前应当提取的法定公积金以及各项准备金的类别、顺序及比例,利润分配的方式等事项作出了明确规定。2015 年,经公司 2015 年第三次临时股东大会、第四次临时股东大会及第五次临时股东大会审议通过,公司对《公司章程》进行了修订。修订后的《公司章程》进一步明确了利润分配的原则、利润分配政策调整的决策程序、利润分配方式等事项。公司制定的利润分配政策符合相关法律法规以及监管规定,公司的利润分配严格按照《公司章程》及有关审议程序的要求执行。



## 第五节 重要事项

### 一、重要事项索引

事项	是或否	索引
是否存在重大诉讼、仲裁事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在对外担保事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产的情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否对外提供借款	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在日常性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(一)
是否存在偶发性关联交易事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(二)
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项或者本年度发生的企业合并事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(三)
是否存在股权激励事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在已披露的承诺事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(四)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(五)
是否存在被调查处罚的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在失信情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否	
是否存在自愿披露的其他重要事项	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	五.二.(六)

### 二、重要事项详情（如事项存在选择以下表格填列）

#### （一）报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
1. 购买原材料、燃料、动力	-	-
2. 销售产品、商品、提供或者接受劳务委托，委托或者受托销售	-	-
3. 投资（含共同投资、委托理财、委托贷款）	-	-
4. 财务资助（挂牌公司接受的）	-	-
5. 公司章程中约定适用于本公司的日常关联交易类型	-	-
6. 其他	-	-
<b>总计</b>	-	-

以上表格不适用

#### 1、公司关联方

报告期内，公司关联方主要包括国资集团、紫金集团及其控制的企业、其他持有公司5%以上股份股东（包括新工集团、凤凰置业及交通集团）、南京银行股份有限公司、富安达基金及其控股子公司等，其他关联方按照企业会计准则以及公司相关制度规定确定。报告期内，公司认定关联方的依据充分，相关关联交易按照监规定和《公司章程》要求履行



了必要的审批程序, 关联交易真实、有效, 定价公允, 不存在发生明显偏离市场公允价格的情形。

## 2、日常性关联交易的预计和执行情况

公司 2016 年年度股东大会审议通过了《关于预计公司二〇一七年度日常性关联交易的议案》, 对公司因日常业务经营所发生的关联交易进行了预计。因市场情况可能经常发生变化, 交易的发生存在不确定性, 交易量难以准确预计, 股东大会同意, 2017 年度的日常性关联交易的可发生金额根据实际发生数确定。关联交易按照市场公允价格定价。2017 年度, 公司与关联方发生的日常关联交易 (单位: 元) 如下:

### (1) 代理买卖证券款

关联方名称	期末
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	9,289,710.77
南京纺织品进出口股份有限公司	773.3
南京国资资产处置有限责任公司	0.01
南京金谷创客空间中心	3.19
南京旅游集团有限责任公司 (注)	257,889.83
南京市保安服务总公司	388,305.92
南京市高新技术风险投资股份有限公司	9,464.80
南京市国有资产投资管理控股 (集团) 有限责任公司	4,514.87
南京市市民卡有限公司	1.02
南京新工投资集团有限责任公司	448.16
南京新农发展集团有限责任公司	203.81
南京新农科创投资有限责任公司	671.59
南京长江发展股份有限公司	5,630.28
南京中成创业投资有限公司	565.53
南京紫金投资集团有限责任公司	210,267.90
南京紫金资产管理有限公司	1,327.12
南京商厦股份有限公司	640.61
南京白宫大酒店	306.88
南京农垦产业 (集团) 有限公司	68.05
关联自然人	466,838.44
合计	10,637,632.08
占代理买卖证券款余额比例	0.15%

注: 南京商贸旅游发展集团有限责任公司于 2017 年更名为南京旅游集团有限责任公司, 下同。

### (2) 代理买卖证券手续费及佣金收入

关联方名称	本期
南京旅游集团有限责任公司	36,382.19
关联自然人	72,571.47
南京紫金资产管理有限公司	18,078.40
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	990,656.53
南京长江发展股份有限公司	138.55
合计	1,117,827.14
占代理买卖证券手续费及佣金收入比例	0.18%





## (3) 证券经纪业务客户存款利息支出

关联方名称	本期
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	65,524.63
南京纺织品进出口股份有限公司	2.73
南京旅游集团有限责任公司	13,672.56
南京市保安服务总公司	1,230.13
南京市高新技术风险投资股份有限公司	2,013.94
南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司	357.35
南京新工投资集团有限责任公司	1.59
南京新农发展集团有限责任公司	607.81
南京新农科创投资有限责任公司	2.38
南京长江发展股份有限公司	665.12
南京中成创业投资有限公司	1.99
南京紫金投资集团有限责任公司	17,358.11
南京紫金资产管理有限公司	1,337.29
南京商厦股份有限公司	2.27
南京白宫大酒店	1.08
南京农垦产业（集团）有限公司	68.17
关联自然人	2,446.17
合计	105,293.32
占代理买卖证券客户资金利息支出比例	0.35%

## (4) 第三方资金存管业务

关联方名称	业务性质	金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	客户资金存管费	149,300.74	0.96

## (5) 交易单元席位租赁

关联方名称	业务性质	金额	比例(%)
富安达基金管理有限公司	席位租赁业务	615,549.70	12.18

## (6) 代理销售金融产品

关联方名称	业务性质	2017 年度
南京银行股份有限公司	代理销售金融产品	1,037,407.05
富安达基金管理有限公司（注）	代理销售金融产品	4,517,903.75
合计		5,555,310.80
占代销金融产品收入比例		35.76%

注：包括富安达基金管理有限公司及其控股子公司富安达资产管理（上海）有限公司；代理关联方产品产生的手续费收入包括代理销售及申购、赎回金融资产产生的手续费收入。

## (7) 保荐、承销与财务顾问业务

关联方名称	业务性质	金额
富安达基金管理有限公司（注）	财务顾问收入	1,326,675.85
南京银行股份有限公司	财务顾问收入	3,419,811.32
紫金信托有限责任公司	财务顾问收入	7,895,946.30
合计		12,642,433.47
占投资银行业务收入比例		14.26%

注：包括富安达基金管理有限公司及控股子公司富安达资产管理（上海）有限公司。

## (8) 债券交易业务



关联方名称	买入全价	买入净价	卖出全价	卖出净价
南京银行股份有限公司	67,075,089.59	66,947,370.00	301,917,906.16	294,602,550.00

## (9) 除证券经纪业务客户资金利息支出外其他业务利息收入、支出

关联方名称	业务性质	金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	资金存放业务利息收入	12,517,383.26	6.13

## (10) 公司为管理人、关联方为委托人的资产管理业务

关联方名称	资产管理计划名称	业务性质	金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	南京证券-广发银行-南京银行定向资产管理合同	资产管理业务收入	99,810.72	0.12
江苏股权交易中心有限责任公司	南证稳赢 1 号资产管理计划	资产管理业务收入	15,037.64	0.00
南京银行股份有限公司	南京证券-南京银行定向 2 号资产管理合同	资产管理业务收入	265,882.50	0.32

## (11) 本公司纳入合并范围的资产管理计划向关联方支付资产管理费

关联方名称	资产管理计划名称	业务性质	金额	比例(%)
富安达资产管理(上海)有限公司	富安达-南证量化 1 号资产管理计划	资产管理费支出	194,576.61	12.36

## (12) 本公司向关联方收取基金管理服务费

关联方名称	业务性质	金额	比例(%)
南京东南巨石价值成长股权投资基金(有限合伙)	基金管理费	144,129.98	70.23
南京巨石高投股权投资中心(有限合伙)	基金管理费	61,084.90	29.77

## (13) 本公司认购(申购)和赎回关联方管理并发行的资产管理产品、理财产品

关联方名称	产品名称	申购份额	赎回份额	期末持有份额
富安达基金管理有限公司	富安达-大朴汇升定增 2 号专项资产管理计划		10,005,800.00	-
富安达基金管理有限公司	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金		9,999,000.00	-
富安达基金管理有限公司	富安达现金货币市场证券投资基金 B	191,603,556.54	191,603,556.54	-
南京银行股份有限公司	理财产品	1,679,610,000.00	1,680,915,000.00	226,465,000.00
富安达基金管理有限公司	富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金		4,999,000.00	-
富安达基金管理有限公司	富安达消费主题灵活配置混合证券投资基金	19,998,675.00	5,000,000.00	14,998,675.00

备注:上表中申购、赎回份额包含了红利再投资、基金转换等因素增减份额;富安达基金管理有限公司包括富安达基金管理有限公司及其子公司富安达资产管理(上海)有限公司。

## (14) 报告期内董事、监事及高级管理人员薪酬

单位:万元

关联方名称	金额
董事、监事及高级管理人员	662.42

## (15) 2016 年 11 月,本公司与南京银行股份有限公司共同认购北京信托宝通 3 号集合资金



信托计划份额，其中本公司认购 1,900.00 万份次级份额，南京银行股份有限公司认购 17,100.00 万份优先级份额。2017 年 10 月本公司和南京银行股份有限公司分别赎回所认购全部份额。2016 年本公司应计优先级利息 133.99 万元，2017 年本公司应计优先级利息 729.21 万元。

(16)2016 年 12 月，本公司与南京银行股份有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》。本公司将持有的“第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划”的全部收益权及其他权利和义务以 371,970,250.00 元价格转让给关联方南京银行股份有限公司，转让时委托资产总额 370,000,000.00 元，本公司取得收益 1,970,250.00 元。2017 年 2 月，本公司与南京银行股份有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》，本公司以 376,202,638.89 元价格受让南京银行股份有限公司持有的“第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划”的全部收益权及其他权利和义务。

(17)2008 年 12 月，本公司与南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司签订《协议书》，双方约定南京国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司将其拥有的南京市中山南路 311 号房产提供给本公司使用，交易金额为零。该房产一直由本公司使用至今。

(18) 根据公司与南京市保安服务总公司及其下属分公司签署的《保安服务合同》，公司部分南京地区分支机构委托其提供保安服务，2017 年发生的保安费为 135.52 万元。

## (二) 报告期内公司发生的偶发性关联交易情况

单位：元

关联方	交易内容	交易金额	是否履行必要决策程序	临时报告披露时间	临时报告编号
南京金融城建设发展股份有限公司	代建服务费	2,250,000	是	2015.10.28	《公开转让说明书》
南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司	为本公司公开发行债券提供担保，报告期末担保余额 10 亿元	0	是	2016.8.24	2016-021
南京金融城建设发展股份有限公司	购买租赁车位	939,100	是	2017.4.27	2017-024
南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司	物业等管理服务费用	6,618,400	是	2017.4.27	2017-024
富安达基金管理有限公司	公司向其同比例增资，增资后出资比例仍为 49%	110,250,000	是	2017.11.14	2017-060
<b>总计</b>	-	120,057,500	-	-	-

### 偶发性关联交易的必要性、持续性以及对公司生产经营的影响：

上述关联交易均因公司经营需要产生，定价合理公平，有利于公司正常经营发展，不会对公司的独立性产生不当影响，不会损害公司及非关联股东的利益，公司的业务经营和发展



不会因上述关联交易而对关联方形成依赖。

报告期末关联方交易业务资金余额及往来款余额,以及关联方及关联交易的具体内容详见本报告财务报表附注九。

### (三) 经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项或者本年度发生的企业合并事项

2017年11月29日,公司二〇一七年第三次临时股东大会审议并通过《关于对富安达基金管理有限公司增资的议案》。富安达基金管理有限公司拟将注册资本增至人民币81,800万元,即富安达基金新增注册资本人民币53,000万元,公司按照原出资比例,以每元注册资本1元的价格认缴25,970万出资额。详见公司于2017年11月14日在全国股转系统官方网站披露的《对外投资暨关联交易公告》(公告编号:2017-060)。截至报告期末,公司已缴纳第一期出资款11,025万元。

### (四) 承诺事项的履行情况

2015年,公司控股股东紫金集团,实际控制人国资集团及控股股东紫金集团直接或间接控制的本公司股东南京紫金资产管理有限公司、南京农垦产业(集团)有限公司、南京高科股份有限公司、南京市国有资产经营有限责任公司、紫金信托有限责任公司、南京市食品公司等分别做出对所持股份自愿锁定的承诺。股东南京新工投资集团有限责任公司在2014年受让公司股份时亦作出锁定股份的承诺(详见公司于2015年10月28日在全国股转系统网站披露的《南京证券股份有限公司公开转让说明书》“第一节基本情况”第三部分)。2015年,公司注册资本由19亿元增至24.73999503亿元,按照证监会《证券公司行政许可审核工作指引第10号——证券公司增资扩股和股权变更》规定,参与本次增资的南京紫金投资集团有限责任公司、南京紫金资产管理有限公司、南京农垦产业(集团)有限公司、南京市国有资产经营有限责任公司、紫金信托有限责任公司和南京国资新城投资置业有限责任公司等6家股东,承诺自本次新增股份持股之日起60个月内不转让本次发行新增取得的股份,其余参与本次增资的股东承诺在36个月内不转让本次发行新增取得的股份,但根据证监会上述规定不受前述持股期限限制的情形除外(详见公司于2015年10月29日在全国股转系统官方网站披露的《南京证券股份有限公司股票发行情况报告书》)。

2015年,公司实际控制人国资集团、控股股东紫金集团分别出具了避免与本公司发生同业竞争的承诺函、关于规范南京证券对外担保和不违规占用南京证券资金的承诺函。公司实际控制人国资集团、控股股东紫金集团及持有公司5%以上股份的股东南京新工投资集团有限责任公司、江苏凤凰置业有限公司及南京市交通建设投资控股(集团)有限责任公司就减少和规范与本公司的关联交易事项分别出具了关于减少并规范关联交易承诺函(详见公司于2015年10月28日在全国股转系统官方网站披露的《南京证券股份有限公司公开转让说明



书》“第三节公司治理”第六部分及第七部分)。

报告期内，未出现违反上述承诺的事项。

#### (五) 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例	发生原因
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	质押	891,343,850.00	3.79%	用于正回购业务质押标的物
买入返售金融资产	质押	329,207,480.00	1.40%	用于正回购业务质押标的物
可供出售金融资产	质押	1,245,122,594.61	5.30%	用于正回购业务质押标的物
融资融券收益权	质押	545,772,214.57	2.32%	用于融资融券收益权转让借款
总计	-	3,011,446,139.18	12.81%	-

#### (六) 自愿披露其他重要事项

##### 1、单项业务资格的变化情况

中国证券业协会于 2017 年 4 月 7 日公示第一批证券公司私募投资基金子公司名单，巨石创投成为证券公司私募投资基金子公司。中国证券业协会于 2017 年 10 月 9 日公示第一批证券公司及其私募投资基金子公司等规范平台名单，巨石创投可以据此办理有关私募基金管理人登记和产品备案。

##### 2、会计师事务所聘任情况及审计费用情况

经公司 2016 年年度股东大会审议批准，公司续聘立信会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2017 年度年报审计机构，为公司提供 2017 年度财务报告审计和 2017 年度内部控制审计服务。立信会计师事务所（特殊普通合伙）本次系连续第七年为本公司提供审计服务，签字会计师孙晓爽本次系连续第三年、签字会计师孙淑平本次系连续第一年为本公司提供审计服务。公司与立信会计师事务所（特殊普通合伙）约定的 2017 年度审计费用合计人民币 95 万元，审计项目包括财务报告审计及内部控制审计等。报告期内，公司向其实际支付的 2016 年度年报相关审计费用 95 万元。

##### 3、重大资产负债表日后事项

(1) 2018 年 2 月 23 日，本公司第二届董事会第十四次会议审议通过 2017 年度利润分配方案，2017 年度不进行利润分配。

(2) 2012 年，本公司与重庆市全鼎投资咨询有限公司（“重庆全鼎投资”）签订合作协议书。因重庆全鼎投资未按约履行义务，本公司未向其支付合同价款。2014 年，重庆全鼎



投资向南京市玄武区人民法院提起诉讼,要求本公司支付合同价款及相关利息合计4,945,561.25元。2016年5月27日,南京市玄武区人民法院作出一审判决,判处本公司败诉,本公司应支付合同价款及相关利息。本公司依法向南京市中级人民法院提起上诉。2016年12月5日,南京市中级人民法院作出终审判决:撤销一审判决,驳回重庆全鼎投资的诉讼请求。2017年12月,江苏省高级人民法院向本公司下发传票,重庆全鼎投资不服南京市中级人民法院上述终审判决,向江苏省高级人民法院申请再审,江苏省高级人民法院通知本公司接受法院询问。江苏省高级人民法院于2018年2月1日驳回其再审申请。





## 第六节 股本变动及股东情况

### 一、普通股股本情况

#### (一) 普通股股本结构

单位：股

股份性质	期初		本期变动	期末		
	数量	比例%		数量	比例%	
无限售条件股份	无限售股份总数	1,458,364,209	58.95%	282,974,505	1,741,338,714	70.39%
	其中：控股股东、实际控制人	452,212,406	18.28%	226,106,203	678,318,609	27.42%
	董事、监事、高管	0	0.00%	0	0	0.00%
	核心员工	0	0.00%	0	0	0.00%
有限售条件股份	有限售股份总数	1,015,635,294	41.05%	-282,974,505	732,660,789	29.61%
	其中：控股股东、实际控制人	293,938,064	11.88%	-226,106,203	67,831,861	2.74%
	董事、监事、高管	0	0.00%	0	0	0.00%
	核心员工	0	0.00%	0	0	0.00%
总股本		2,473,999,503	-	0	2,473,999,503	-
普通股股东人数						136

#### (二) 普通股股东情况

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有限售股份数量	期末持有无限售股份数量
1	南京紫金投资集团有限责任公司	746,150,470	0	746,150,470	30.16%	67,831,861	678,318,609
2	南京新工投资集团有限责任公司	208,014,970	0	208,014,970	8.41%	208,014,970	0
3	江苏凤凰置业有限公司	200,207,344	0	200,207,344	8.09%	0	200,207,344
4	南京市交通建设投资控股(集团)有限责任公司	174,726,409	0	174,726,409	7.06%	29,121,068	145,605,341
5	南京紫金资产管理有限公司	97,879,146	0	97,879,146	3.96%	8,898,104	88,981,042
6	江苏云杉资本管理有限公司	57,510,000	0	57,510,000	2.32%	40,000,000	17,510,000
7	南京农垦产业(集团)有限公司	52,668,585	0	52,668,585	2.13%	12,111,431	40,557,154



	司						
8	南京长江发展股份有限公司	51,654,378	0	51,654,378	2.09%	12,775,730	38,878,648
9	南京市国有资产经营有限责任公司(注)	51,010,107	0	51,010,107	2.06%	41,835,018	9,175,089
10	南京东南国资投资集团有限责任公司	50,000,000	0	50,000,000	2.02%	50,000,000	0
10	南京国资新城投资置业有限责任公司	50,000,000	0	50,000,000	2.02%	50,000,000	0
<b>合计</b>		<b>1,739,821,409</b>	<b>0</b>	<b>1,739,821,409</b>	<b>70.32%</b>	<b>520,588,182</b>	<b>1,219,233,227</b>

以上股东间相互关系说明

1、前十名股东间相互关系说明：前十大股东中，南京紫金投资集团有限责任公司持有南京紫金资产管理有限公司 100%股权，南京新农发展集团有限责任公司持有南京农垦产业(集团)有限公司 100%股权，南京旅游集团有限责任公司持有南京市国有资产经营有限责任公司 100%股权，南京安居建设集团有限公司持有南京国资新城投资置业有限责任公司 100%股权；南京紫金投资集团有限责任公司、南京新农发展集团有限责任公司、南京旅游集团有限责任公司、南京安居建设集团有限公司均为南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司的全资子公司。南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司是南京市人民政府国有资产监督管理委员会作为唯一出资人的国有独资公司。

2、报告期内，不存在前十大股东将其所持公司股份质押或所持公司股份被冻结的情形。

注：2017年7月，南京市国有资产经营公司更名为南京市国有资产经营有限责任公司。

## 二、 优先股股本基本情况

适用 不适用

## 三、 控股股东、实际控制人情况

### (一) 控股股东情况

公司控股股东为南京紫金投资集团有限责任公司，法定代表人王海涛，总经理陈峥，成立日期 2008 年 6 月 17 日，统一社会信用代码 91320100674919806G，注册资本 500,000 万元人民币，主营业务为股权投资、实业投资、资产管理、财务咨询、投资咨询。

报告期内，公司控股股东未发生变化。

### (二) 实际控制人情况

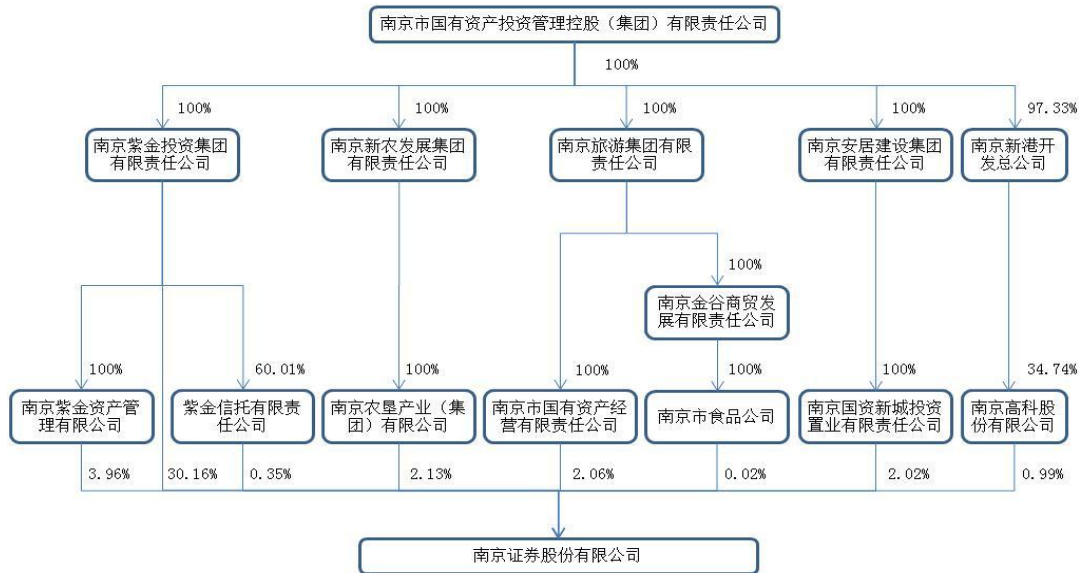
公司实际控制人为南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司，法定代表人王海涛，总经理倪忠翔，成立日期 2002 年 9 月 3 日，统一社会信用代码 913201007423563481，注册资本 500,000 万元人民币，主营业务为：授权资产的营运与监管、资本运营、资产委托经营、产权经营、项目评估分析、风险投资、实业投资、项



目开发、物业管理、不良资产处置、债权清收、财务顾问及其他按法律规定可以从事的和市政府委托的相关经营业务。

报告期内，公司实际控制人未发生变化。

报告期末，南京市国有资产管理控股（集团）有限责任公司对公司的控制关系如下：



注：2017年11月，南京旅游商贸发展集团有限责任公司更名为南京旅游集团有限责任公司。



## 第七节 融资及利润分配情况

### 一、最近两个会计年度内普通股股票发行情况

单位:元/股

发行方案公告时间	新增股票挂牌转让日期	发行价格	发行数量	募集金额	发行对象中董监高与核心员工人数	发行对象中做市商家数	发行对象中外部自然人人数	发行对象中私募投资基金家数	发行对象中信托及资管产品家数	募集资金用途是否变更

#### 募集资金使用情况:

最近两个会计年度内,公司未发行普通股股票。

### 二、存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

### 三、债券融资情况

适用 不适用

单位:元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续时间	是否违约
118908.SZ	14 南京债	其他	700,000,000.00	5.80	4 年(2+2)	否
118918.SZ	15 南京 01	其他	1,000,000,000.00	5.90	2 年	否
118924.SZ	15 南京 02	其他	1,300,000,000.00	6.05	2 年	否
118326.SZ	15 宁证 01	公司债券(大公募、小公募、非公开)	1,200,000,000.00	6.00	2 年	否
143341.SH	17 南京 01	公司债券(大公募、小公募、非公开)	1,000,000,000.00	4.88	5 年(3+2)	否
合计	-	-	5,200,000,000.00	-	-	-

报告期内,公司面向合格投资者公开发行公司债券募集资金 10 亿元,期末余额为 10 亿元;报告期内到期兑付次级债 23 亿元(15 南京 01 和 15 南京 02),期末尚未到期次级债余额为 7 亿元;报告期内到期兑付非公开发行公司债 12 亿元(15 宁证 01),期末无非公开发行公司债余额。

为了满足业务资金需求,拓展融资渠道,在保证各项风控及财务指标符合监管规定的情况下,报告期内,公司发行收益凭证 16.70 亿元,到期兑付 0.16 亿元,截至报告期末,



收益凭证余额 16.54 亿元。

#### 债券违约情况

适用 不适用

#### 公开发行债券的特殊披露要求

适用 不适用

### 一、公司已发行且截至本报告签署日未到期的债券基本信息

#### (一) 14 南京债

1、本期债券名称:南京证券股份有限公司 2014 年次级债券(简称“14 南京债”,代码:118908)。

2、本期债券期限:本期次级债券期限为 4 年期,并附第 2 年末发行人上调票面利率选择权及投资者回售选择权。

3、票面利率:本期债券采用固定利率形式,票面年利率为 5.8%,并在债券存续期内的前 2 年固定不变。本期债券存续期限的第 2 年末,发行人可选择调整票面利率 0 至 100 个基点(含本数),债券票面年利率为债券存续期前 2 年票面年利率加上发行人上调的基点,在债券存续期后 2 年固定不变。

4、本期债券的发行规模:本期债券的发行规模人民币 7 亿元。

5、发行日:本期债券发行日为 2014 年 11 月 19 日。

6、计息期限:本期债券的计息期限为 2014 年 11 月 19 日至 2018 年 11 月 18 日。

7、还本付息方式:本期债券采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。年度付息款项自付息日起不另计利息,本金自本金兑付日起不另计利息。

8、到期日:本期债券的到期日为 2018 年 11 月 19 日,若投资者行使回售选择权,则本期次级债券的到期日为 2016 年 11 月 19 日。前述日期如遇法定节假日或休息日,则兑付顺延至下一个工作日,顺延期间不另计息。

9、次级条款:本期债券本金和利息的清偿顺序在发行人的普通债之后;本期债券与发行人已经发行的其他次级债务处于同一清偿顺序;除非发行人结业、倒闭或清算,投资者不能要求发行人加速偿还本期债券的本金。

10、信用等级:经联合信用评级有限公司综合评定,发行人主体信用等级为 AA+。

11、公司债券上市和转让的交易场所:本期发行的次级债券在深圳证券交易所上市和转让。

12、募集资金用途:本期次级债券的募集资金全部用于补充公司营运资金。

13、报告期内选择权条款的执行情况:报告期内未发生选择性条款的执行情况。

14、投资者适当性安排:本期债券的发行对象为符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的合格机构投资者,且不超过 200 名。本期债券以非公开方式通过深圳证券交易所向具备相应风险识别和承担能力的合格机构投资者发行。



15、公司债券的付息兑付情况:报告期内付息情况正常,未发生兑付情况。

16、债券余额:700,000,000 元

## (二) 17 南京 01

1、债券名称:南京证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券(第一期)(简称“17 南京 01”,代码:143341)。

2、发行规模:本次公司债券采用分期发行方式,第一期债券发行规模为 10 亿元。

3、债券期限:本期债券期限为 5 年,附债券发行后第 3 年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权。

4、票面利率:本期债券为固定利率债券,票面利率为 4.88%,在债券存续期内前 3 年固定不变,在本期债券存续期的第 3 年末,如发行人行使上调票面利率选择权,未被赎回或回售部分的债券票面利率为存续期内前 3 年票面利率加上调基点,并在债券存续期后 2 年固定不变。

5、还本付息方式:采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。

6、发行日:2017 年 10 月 24 日。

7、到期日:本期债券的到期日为 2022 年 10 月 24 日,若投资者行使回售选择权,则回售部分债券的到期日为 2020 年 10 月 24 日,前述日期如遇法定节假日或休息日,则兑付顺延至下一个工作日,顺延期间不另计息。

8、计息期限:本期债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止,若投资者行使回售权,则计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2020 年 10 月 23 日止,未回售部分债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止。

9、担保情况:本期债券由南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司提供全额无条件不可撤销的连带责任保证担保。

10、信用级别及资信评级机构:经联合信用评级有限公司综合评定,发行人主体信用等级为 AA+,本期债券信用等级为 AAA。

11、主承销商/簿记管理人/债券受托管理人:华安证券股份有限公司。

12、募集资金用途:本次发行募集资金扣除发行费用后全部用于补充公司营运资金。

13、公司债券上市和转让的交易场所:本次发行的公司债券在上海证券交易所上市和转让。

14、报告期内选择权条款的执行情况:报告期内未发生选择性条款的执行情况。

15、投资者适当性安排:本期债券的发行对象为符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的合格投资者。本期债券以公开方式通过上海证券交易所向具备相应风险识别和承担能力的合格投资者簿记建档发行。

16、公司债券的付息兑付情况:报告期内无兑付付息情况。





17、债券余额: 1,000,000,000 元

## 二、相关债券的中介机构情况

### (一) 14 南京债

1、会计师事务所: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市南京东路 61 号 4 楼

法定代表人: 朱建弟

签字会计师: 孙晓爽、高民

办公地址: 南京市江东中路 359 号国睿大厦 2 号 18 楼

联系电话: 025-85653829

传真: 025-83309819

邮政编码: 210000

2、信用评级机构: 联合信用评级有限公司

住所: 天津市南开区水上公园北道 38 号爱丽园公寓 508

法定代表人: 李信宏

联系人: 刘洪涛 陈凝

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 2 号 PICC 大厦 12 层

联系电话: 010-85172818

传真: 010-85171273

邮政编码: 100022

3、中介机构变动情况

报告期内未发生中介机构变动情况。

### (二) 17 南京 01

1、会计师事务所: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市南京东路 61 号四楼

法定代表人: 朱建弟

签字会计师: 孙晓爽、高民

办公地址: 南京市江东中路 359 号国睿大厦 2 号 18 楼

联系电话: 025-85653829

传真: 025-83309819

邮政编码: 210000

2、债券受托管理人: 华安证券股份有限公司

办公地址: 安徽合肥政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 章宏韬

联系人: 叶倩、林玉珑、陈信帅、朱荣波、田硕



联系电话: 010-56683569; 0551-65161650-8020

传真: 0551-65161659

邮政编码: 230081

3、信用评级机构: 联合信用评级有限公司

住所: 天津市南开区水上公园北道 38 号爱丽园公寓 508

法定代表人: 李信宏

联系人: 张祎、张晨露

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 2 号 PICC 大厦 12 层

联系电话: 010-85172818

传真: 010-85171273

邮政编码: 100022

4、中介机构变动情况

报告期内未发生中介机构变动情况。

### 三、募集资金使用情况

#### 1、14 南京债

“14 南京债”于《公司债券受托管理人职业行为准则》颁发之前发行,未设置募集资金专户,我公司严格按照公司《2014 年次级债券募集说明书》中的募集资金用途使用资金。截至 2017 年 12 月 31 日,公司向合格机构投资者发行“14 南京债”所募集资金 7 亿元,已全部用于补充公司营运资金。

#### 2、17 南京 01

为有效保证本期债券的资金归集以及债券本息的按时、足额兑付,发行人在上海浦东发展银行股份有限公司南京鼓楼支行开立专项账户用于募集资金的归集以及本期债券的偿付。该募集资金专户在报告期内运行正常。

我公司严格按照《南京证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券账户监管协议》约定提取资金,严格按照《南京证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券(第一期)募集说明书》中的募集资金用途使用资金。募集资金专项账户期末余额 91,833.24 元。

#### 3、债券募集资金的专项审计情况

本公司根据相关监管规定就已发行债券所募集资金存放和使用情况编制了专项说明。立信会计师事务所(特殊普通合伙)就此出具了《南京证券股份有限公司募集资金年度存放与使用情况鉴证报告》(信会师报字【2018】第 ZH30013 号),认为我公司 2017 年度《关于公司募集资金存放与使用情况的专项说明》在所有重大方面符合中国证券监督管理委员会令【2015】第 113 号《公司债券发行与交易管理办法》、中国证券监督管理委员会公告【2012】51 号《证券公司次级债管理规定》、《深圳证券交易所非公开发行公司债券业务管理暂行办法》(深证上【2015】240 号)的规定,并在所有重大方面如实反映了我公司募集资金 2017



年度实际存放与使用情况。

#### 四、评级情况

(一) “14 南京债”无债项评级，不适用。

(二) 根据联合信用评级有限公司于 2017 年 9 月 28 日出具的《南京证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券（第一期）信用评级分析报告》，公司主体信用等级为 AA+，17 南京 01 的信用等级为 AAA。联合信用将在本期债券存续期内，南京证券股份有限公司完成审计报告后 2 个月内对南京证券股份有限公司 2017 年公司债券进行一次定期跟踪评级，资信评级机构跟踪评级报告同时在评级机构和交易所网站公告。

报告期内未进行不定期跟踪评级。报告期内，评级结果与上一次评级结果相比无变化。

#### 五、增信机制、偿债计划及保障措施

(一) 14 南京债

- 1、“14 南京债”无担保等增信机制；
- 2、“14 南京债”付息情况正常，偿债计划未发生变更；
- 3、“14 南京债”偿债保障措施正常执行，与募集说明书的相关承诺保持一致；
- 4、“14 南京债”在报告期内未召开债券持有人会议。

(二) 17 南京 01

- 1、“17 南京 01”由南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司提供全额无条件不可撤销的连带责任保证担保；
- 2、“17 南京 01”偿债计划未发生变更；
- 3、“17 南京 01”偿债保障措施正常执行。专项账户资金提取情况正常，与募集说明书的相关承诺保持一致。
- 4、“17 南京 01”在报告期内未召开债券持有人会议。

#### 六、“17 南京 01”担保人情况

(一) 担保人财务情况

鉴于担保人尚未完成合并报表及审计工作，因此本次披露的担保人财务信息为担保人未经审计的 2017 年度母公司数据。待担保人完成合并报表的审计后，公司将另行披露担保人相关财务数据。

根据致同会计师事务所（特殊普通合伙）出具的致同审字【2017】第【320ZA0063】号财务审计报告和未经审计的 2017 年度财务报表，南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司 2016 年及 2017 年母公司主要财务数据如下：

单位：元

项目	2017 年 12 月 31 日/2017 年 度	2016 年 12 月 31 日/2016 年度
资产总额	36,267,072,780.53	35,466,458,696.29



流动资产合计	7,127,415,939.92	9,274,534,792.73
非流动资产合计	29,139,656,840.61	26,191,923,903.56
负债合计	10,522,119,790.63	11,601,226,622.13
所有者权益	25,744,952,989.90	23,865,232,074.16
资产负债率	29.01%	32.71%
营业总收入	8,025,739.53	13,303,939.58
利润总额	-66,305,770.42	-114,183,061.91
净利润	-66,879,084.26	-112,361,966.25
经营活动产生的现金流量净额	1,500,379,504.57	-77,547,375.04
投资活动产生的现金流量净额	-1,973,266,701.80	-1,694,459,437.87
筹资活动产生的现金流量净额	469,426,680.00	1,768,858,301.86
现金及现金等价物净增加额	-3,460,517.23	-3,148,511.05
净资产收益率	-	-
流动比率	3.53	2.99
速动比率	3.53	2.99

注：由于母公司净利润为负，因此净资产收益率未做计算。

## （二）担保人资信状况

经中诚信国际信用评级有限责任公司综合评定（信评委函字[2017]跟踪 0808 号），担保人南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司的主体评级结果为 AAA，评级展望为稳定。其提供的无条件不可撤销连带责任保证担保为本期债券的偿还提供了进一步的保障。

## （三）担保人主要资产（一级子公司）情况

担保人为控股型集团公司，担保人所拥有的除发行人股权外的其他资产主要是担保人其他子公司股权，该部分股权不存在权利限制以及后续权利限制安排，具体情况如下：

单位：万元

企业名称	企业类型	注册资本	投资额	持股比例
南京紫金投资集团有限责任公司	境内非金融子企业	500,000.00	500,000.00	100.00%
南京旅游集团有限责任公司	境内非金融子企业	138,005.64	138,005.64	100.00%
南京新农发展集团有限责任公司	境内非金融子企业	27,000.00	27,000.00	100.00%
南京安居建设集团有限责任公司	境内非金融子企业	400,000.00	1,200,846.27	100.00%



南京新港开发总公司	境内非金融子 企业	896,363.51	872,416.51	97.33%
-----------	--------------	------------	------------	--------

## (四) 担保人(母公司)已发行债券工具

债券名称	期末余额(元)
14 宁国资 MTN1	2,000,000,000.00
16 宁国资 MTN2	2,000,000,000.00
13 宁国资债 01	2,100,000,000.00
13 宁国资债 02	2,400,000,000.00
合计	8,500,000,000.00

## (五) 担保人累计对外担保金额

截至 2017 年末, 担保人(母公司)对外保证担保金额合计 217 亿元, 占 2017 年末母公司净资产比例为 84.29%。具体情况如下:

- (1) 为南京城市建设基金的贷款行(多家银团)提供 180 亿元担保。
- (2) 为南京黄马实业有限公司贷款担保 1 亿元。
- (3) 为南京证券股份有限公司公开发行公司债提供 36 亿元的担保。

## 七、受托管理人履职情况

(一) “14 南京债”为《公司债券受托管理人职业行为准则》颁发之前发行, 无受托管理人。

(二) 报告期内, 华安证券股份有限公司作为“17 南京 01”的受托管理人, 在履行职责时不存在利益冲突情形。《南京证券股份有限公司 2017 年公司债券受托管理事务报告》预计在公司 2017 年年度报告公布后 2 个月内披露。相关报告内容详见上海证券交易所网站公告。

## 八、公司财务及资产等状况

## (一) 财务指标

主要财务数据及财务指标	本期/本期期末	上年同期/上年同期期末	比上期变动	变动原因
总资产	23,501,546,945.82	26,858,367,957.04	-12.50%	
归属于母公司股东的净资产	9,366,633,186.64	9,248,029,892.30	1.28%	
营业收入	1,384,562,680.80	1,499,611,313.01	-7.67%	
归属于母公司股东的净利润	410,602,756.36	493,557,293.51	-16.81%	
EBITDA	898,731,775.05	1,255,102,874.96	-28.39%	
经营活动产生的现金流量净额	-1,056,716,132.59	-3,097,455,541.18	65.88%	主要为回购业务资金流出减少、代理买卖证券款支付的现金减少。
投资活动产生的现金流量净额	-201,257,161.24	-182,070,848.31	-10.54%	
筹资活动产生的现金流量净额	-1,738,163,744.91	-2,414,448,046.47	28.01%	



期末现金及现金等价物余额	8,136,835,013.49	11,134,854,750.24	-26.92%	
流动比率	3.04	5.01	-39.32%	负债结构改变导致流动比率变小。
速动比率	3.04	5.01	-39.32%	负债结构改变导致速动比率变小。
资产负债率	42.85%	46.97%	-8.77%	
EBITDA 全部债务比	14.47%	18.24%	-20.67%	
EBITDA 利息保障倍数	3.26	2.24	45.54%	主要为公司本期利息支出减少。
利息保障倍数	2.97	2.16	37.50%	主要为公司本期利息支出减少。
现金利息保障倍数	-2.31	-6.21	62.80%	经营性现金流量净流量增大导致
贷款偿还率	不适用	不适用	-	
利息偿付率	100.00%	100.00%	0.00%	

上述财务指标的计算方法如下:

资产负债率=(负债总额-代理买卖证券款-代理承销证券款)/(资产总额-代理买卖证券款-代理承销证券款)

全部债务=期末短期借款+期末交易性金融负债+期末拆入资金+期末卖出回购金融资产+期末应付债券+期末长期借款+期末应付短期融资款+期末融入资金

流动比率=(货币资金+结算备付金+拆出资金+融出资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产+衍生金融资产+买入返售金融资产+应收账款+应收利息+持有待售资产+存出保证金+可供出售金融资产-客户存款-客户备付金)/(短期借款+应付短期融资款+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+代理承销证券款+持有待售负债+应付职工薪酬+应交税费+应付款项+应付利息)

速动比率=(货币资金+结算备付金+拆出资金+融出资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产+衍生金融资产+买入返售金融资产+应收账款+应收利息+持有待售资产+存出保证金+可供出售金融资产-客户存款-客户备付金)/(短期借款+应付短期融资款+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+代理承销证券款+持有待售负债+应付职工薪酬+应交税费+应付款项+应付利息)

EBITDA=利润总额+利息支出-客户资金利息支出+折旧+无形资产摊销+长期待摊费用摊销

EBITDA 全部债务比=EBITDA/全部债务

EBITDA 利息保障倍数=EBITDA/(利息支出-客户资金利息支出)

利息保障倍数=(利润总额+利息支出-客户资金利息支出)/(利息支出-客户资金利息支出)

贷款偿还率=实际贷款偿还额/应偿还贷款额

利息偿付率=实际支付利息/应付利息

现金利息保障倍数=(经营活动产生的现金流量净额+现金利息支出+所得税付现)/现金利息支出

## (二) 其他债券和债务融资工具兑付兑息情况及对外担保情况

截至 2017 年 12 月 31 日, 本公司发行的各期债券和债务融资工具均按时兑付兑息。南京证券股份有限公司 2015 年次级债券(第一期), 已经于 2017 年 3 月 3 日完成了兑付兑息及摘牌工作; 南京证券股份有限公司 2015 年次级债券(第二期), 已经于 2017 年 4 月 17 日完成了兑付兑息及摘牌工作; 南京证券股份有限公司 2015 年非公开发行公司债券(第一期), 已经于 2017 年 6 月 26 日完成了兑付兑息及摘牌工作。

报告期内安排收益凭证及两融收益权转让到期兑付 3.16 亿元, 截至报告期末, 收益凭证及两融收益权转让融资余额 21.54 亿元。





报告期内公司无对外担保情况。

### (三) 授信情况、使用情况

报告期内不存在逾期偿还贷款的情况。

公司资信状况优良,与国内主要银行等金融企业保持着长期合作伙伴关系,无展期和减免贷款状况发生。截至 2017 年 12 月 31 日,公司已获得银行等金融企业的授信额度 357.1 亿元人民币,尚未使用的授信额度总额为 338.1 亿元人民币,具体如下:

单位:亿元

序号	银行	授信额度	已批授信有效期	未使用额度
1	中国银行	15	2017.01-2018.01	6
2	南京银行	15	2017.05-2018.05	15
3	邮储银行	10	2017.11-2018.11	10
4	紫金农商行	30	2017.06-2018.06	30
5	证金公司	22	2015.02-长久	22
6	农业银行	40	2017.10-2018.10	35
7	江苏银行	30	2017.01-2018.01	30
8	招商银行	20	2017.01-2018.01	20
9	广发银行	17.1	2017.07-2018.07	17.1
10	浦发银行	29	2017.08-2018.08	29
11	交通银行	15	2017.07-2018.07	10
12	建设银行	20	2017.12-2018.12	20
13	工商银行	10	2017.12-2018.12	10
14	宁波银行	5	2017.11-2018.11	5
15	宁波舟山港财务公司	4	2017.01-2018.01	4
16	平安银行	16	2017.12-2018.12	16
17	恒丰银行	20	2017.08-2018.08	20
18	廊坊银行	20	2017.04-2018.04	20
19	北京银行	5	2017.01-2018.01	5
20	民生银行	14	2017.09-2018.09	14
总计		357.1		338.1

(四) 报告期内,公司未发生违反公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况,对债券投资者利益没有产生影响。

(五) 报告期内,公司未发生《公司债券发行与交易管理办法》第四十五条列示的重大事项,对公司经营情况和偿债能力没有产生影响。

### (六) 公司会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正及对经营成果影响

详见本报告第四节“管理层讨论与分析”之“二、经营情况回顾”“（六）会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正”。

## 九、“17 南京 01”担保人 2017 年未经审计母公司财务报表



## 资 产 负 债 表

单位:南京市国有资产投资管理控股(集团)有  
限责任公司

日期:2017-12-31

单位:元

资产	行次	期末余额	年初余额	负债和所有者权益 (或股东权益)	行次	期末余额	年初余额
<b>流动资产:</b>	<b>1</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>流动负债:</b>	<b>34</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
货币资金	2	5,205,952.70	8,666,469.93	短期借款	35	0.00	0.00
以公允价值计量且其变动计入当前损益的金融资产	3	20,854,325.95	20,281,012.11	交易性金融负债	36	0.00	0.00
应收票据	4	0.00	0.00	应付票据	37	0.00	0.00
应收账款	5	0.00	0.00	应付账款	38	0.00	0.00
预付款项	6	0.00	0.00	预收款项	39	0.00	0.00
应收利息	7	0.00	0.00	应付职工薪酬	40	883,241.46	997,145.06
应收股利	8	0.00	0.00	应交税费	41	709,498.59	1,783,741.42
其他应收款	9	7,101,355,661.27	8,305,889,210.66	应付利息	42	40,631,917.40	40,631,917.40
存货	10	0.00	0.00	应付股利	43	0.00	0.00
一年内到期的非流动资产	11	0.00	0.00	其他应付款	44	1,979,624,816.31	2,057,813,818.25
其他流动资产	12	0.00	939,698,100.03	一年内到期的非流动负债	45	0.00	1,000,000,000
<b>流动资产合计</b>	<b>13</b>	<b>7,127,415,939.92</b>	<b>9,274,534,792.73</b>	其他流动负债	46	0.00	0.00
<b>非流动资产:</b>	<b>14</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>流动负债合计</b>	<b>47</b>	<b>2,021,849,473.76</b>	<b>3,101,226,622.13</b>
可供出售金融资产	15	300,700,000.00	700,000.00	<b>非流动负债:</b>	<b>48</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
持有至到期投资	16	724,000,000.00	0.00	长期借款	49	0.00	0.00
长期应收款	17	0.00	0.00	应付债券	50	8,500,000,000.00	8,500,000,000.00
长期股权投资	18	28,011,524,035.42	26,079,388,669.42	长期应付款	51	0.00	0.00
投资性房地产	19	0.00	0.00	专项应付款	52	0.00	0.00



固定资产	20	103,432,805.19	111,470,170.40	预计负债	53	0.00	0.00
在建工程	21	0.00	0.00	递延所得税负债	54	270,316.87	0.00
工程物资	22	0.00	0.00	其他非流动负债	55	0.00	0.00
固定资产清理	23	0.00	0.00	非流动负债合计	56	8,500,270,316.87	8,500,000,000.00
生产性生物资产	24	0.00	0.00	负债合计	57	10,522,119,790.63	11,601,226,622.13
油气资产	25	0.00	0.00	所有者权益(或股东权益):	58	0.00	0.00
无形资产	26	0.00	0.00	实收资本(或股本)	59	5,000,000,000.00	5,000,000,000.00
开发支出	27	0.00	0.00	资本公积	60	20,142,488,056.26	18,195,888,056.26
商誉	28	0.00	0.00	减:库存股	61	0.00	0.00
长期待摊费用	29	0.00	62,066.77	其他综合收益	62	0.00	0.00
递延所得税资产	30	0.00	302,996.97	盈余公积	63	289,936,947.82	289,936,947.82
其他非流动资产	31	0.00	0.00	未分配利润	64	312,527,985.82	379,407,070.08
				一般风险准备	65	0.00	0.00
非流动资产合计	32	29,139,656,840.61	26,191,923,903.56	所有者权益(或股东权益)合计	66	25,744,952,989.90	23,865,232,074.16
资产总计	33	36,267,072,780.53	35,466,458,696.29	负债和所有者权益(或股东权益)总计	67	36,267,072,780.53	35,466,458,696.29

## 利润表

单位:南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司

日期:2017-12-31

单位:元

项目	行次	本月金额	累计金额
一、营业收入	1	2,051,897.73	8,025,739.53
减:营业成本	2	680,656.24	2,634,123.52
税金及附加	3	1,468,494.37	2,954,192.62
销售费用	4	-	-
管理费用	5	3,240,549.34	13,413,988.55
财务费用	6	30,790,700.38	99,410,796.37
资产减值损失	7	-	-



加:公允价值变动收益(损失以“-”填列)	8	-199,511.13	573,313.84
投资收益(损失以“-”填列)	9	1,639,221.92	43,508,277.27
其中:对联营企业和合营企业的投资收益	10	-	-
二、营业利润(亏损以“-”号填列)	11	-32,688,791.81	-66,305,770.42
加:营业外收入	12	-	-
减:营业外支出	13	-	-
其中:非流动资产处置损失	14	-	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	15	-32,688,791.81	-66,305,770.42
减:所得税费用	16	573,313.84	573,313.84
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	17	-33,262,105.65	-66,879,084.26
归属母公司的净利润	18	-33,262,105.65	-66,879,084.26
少数股东损益	19	-	-
五、其他综合收益的税后净额	20	-	-
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额	21	-	-
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	22	-	-
六、综合收益总额	23	-33,262,105.65	-66,879,084.26
归属于母公司所有者的综合收益总额	24	-33,262,105.65	-66,879,084.26
归属于少数股东的综合收益总额	25	-	-
年初未分配利润	26	-	379,407,070.08
提取法定盈余公积金	27	-	-
应付现金股利(利润)	28	-	-
转作股本的股利	29	-	-
盈余公积补亏	30	-	-
以前年度损益调整	31	-	-
其他	32	-	-
提取法定公益金	33	-	-
未分配利润	34	-	312,527,985.82
七、每股收益:	35	-	-
(一)基本每股收益	36	-	-
(二)稀释每股收益	37	-	-
投资收益(损失以“-”号填列)	38	-	-
其中:对联营企业和合营企业的投资收益	39	-	-
汇兑收益(损失以“-”号填列)	40	-	-

## 现金流量表

单位:南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司

日期:2017-12-31 单位:元

项 目	行次	本月金额	累计金额
-----	----	------	------



一、经营活动产生的现金流量：	1	---	---
销售商品、提供劳务收到的现金	2	-111,739.27	8,363,378.51
收到的税费返还	3	-	5,405.74
收到其他与经营活动有关的现金	4	39,057,290.36	2,232,020,625.24
<b>经营活动现金流入小计</b>	5	38,945,551.09	2,240,389,409.49
购买商品、接受劳务支付的现金	6	-	-
支付给职工以及为职工支付的现金	7	159,233.25	2,454,073.21
支付的各项税费	8	6,810.10	3,324,413.00
支付其他与经营活动有关的现金	9	407,658.86	734,231,418.71
<b>经营活动现金流出小计</b>	10	573,702.21	740,009,904.92
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	11	38,371,848.88	1,500,379,504.57
二、投资活动产生的现金流量：	12	-	-
收回投资收到的现金	13	-	4,445,000,000.00
取得投资收益收到的现金	14	-19,942,052.06	58,356,848.20
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	15	-	-
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	16	-	-
收到其他与投资活动有关的现金	17	-	-
<b>投资活动现金流入小计</b>	18	-19,942,052.06	4,503,356,848.20
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	19	-	23,550.00
投资支付的现金	20	19,000,000.00	6,476,600,000.00
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	21	-	-
支付其他与投资活动有关的现金	22	-	-
<b>投资活动现金流出小计</b>	23	19,000,000.00	6,476,623,550.00
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>	24	-38,942,052.06	-1,973,266,701.80
三、筹资活动产生的现金流量：	25	-	-
吸引投资收到的现金	26	-	1,946,600,000.00
取得借款收到的现金	27	-	-
收到其他与筹资活动有关的现金	28	-	-
<b>筹资活动现金流入小计</b>	29	-	1,946,600,000.00
偿还债务支付的现金	30	-	1,000,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	31	-	466,000,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金	32	-	11,173,320.00
<b>筹资活动现金流出小计</b>	33	-	1,477,173,320.00
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>	34	-	469,426,680.00
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	35	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	36	-570,203.18	-3,460,517.23
加：期初现金及现金等价物余额	37	5,776,155.88	8,666,469.93
六、期末现金及现金等价物余额	38	5,205,952.70	5,205,952.70

#### 四、可转换债券情况

适用 不适用



## 五、 间接融资情况

单位：元

融资方式	融资方	融资金额	利息率%	存续时间	是否违约
融资融券收益权转让	交通银行	500,000,000.00	5.4%	360 天	否
融资融券收益权转让	招商银行	300,000,000.00	5.05	91 天	否
合计	-	800,000,000.00	-	-	-

## 违约情况：

适用 不适用

## 六、 利润分配情况

## (一) 报告期内的利润分配情况

适用 不适用

单位：元/股

股利分配日期	每 10 股派现数（含税）	每 10 股送股数	每 10 股转增数
2017 年 7 月 13 日	1.00	0	0
合计	1.00	0	0

## (二) 利润分配预案

适用 不适用

单位：元/股

项目	每 10 股派现数（含税）	每 10 股送股数	每 10 股转增数
年度分配预案	0	0	

## 未提出利润分配预案的说明：

适用 不适用



## 第八节 董事、监事、高级管理人员及员工情况

### 一、 董事、监事、高级管理人员情况

#### (一) 基本情况

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	学历	任期	是否在公司 领取薪酬	年度 薪酬
步国甸	董事长	男	59	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	60.80
王海涛	副董事长	男	57	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
李剑锋	董事、总裁	男	53	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	57.79
陈 崢	董事	女	50	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
肖 玲	董事	女	42	大学	2016.5.12-2019.5.11	否	0
毕 胜	董事	男	45	硕士	2017.5.18-2019.5.11	否	0
代士健	董事	男	41	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
李小林	董事	男	57	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
孙 隽	董事	女	38	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
吴 斐	董事	男	34	硕士	2016.5.12-2019.5.11	否	0
李心丹	独立董事	男	52	博士	2016.5.12-2019.5.11	是	9.60
陈传明	独立董事	男	61	博士	2016.5.12-2019.5.11	是	9.60
孙文俊	独立董事	男	52	博士	2016.5.12-2019.5.11	是	9.60
张 宏	独立董事	男	58	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	9.60
李明辉	独立董事	男	44	博士	2016.5.12-2019.5.11	是	9.60
陈 晏	监事会主席	女	58	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	45.07
黄 涛	监事	女	46	大学	2016.5.12-2019.5.11	否	0
吴 捷	监事	女	49	硕士	2016.5.17-2019.5.11	否	0
周坚宁	监事	女	59	大专	2016.5.12-2019.5.11	否	0
穆 康	职工代表监事	男	44	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	38.12
胡晨顺	职工代表监事	男	46	大学	2016.5.12-2019.5.11	是	36.24
闻长兵	职工代表监事	男	48	硕士	2016.6.12-2019.5.11	是	33.06
夏宏建	副总裁	男	45	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	40.60
秦 雁	副总裁	男	45	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	41.50
黄锡成	副总裁	男	50	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	40.88
江念南	总工程师	男	53	博士	2016.5.12-2019.5.11	是	41.50
邱 楠	副总裁、董事 会秘书	男	51	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	40.89
刘 宁	财务总监	女	51	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	47.00
校 坚	合规总监	男	45	硕士	2016.5.12-2019.5.11	是	44.13
赵贵成	首席风险官	男	54	大学	2016.5.12-2019.5.11	是	46.84
齐世洁	董事（离任）	男	62	大专	2016.5.12-2017.5.17	否	0
董事会人数：							15
监事会人数：							7
高级管理人员人数：							9

**董事、监事、高级管理人员相互间关系及与控股股东、实际控制人间关系:**

董事步国甸、王海涛、李剑锋、陈峥、李小林、孙隽及监事陈晏系公司控股股东紫金集团推荐,其中董事王海涛、陈峥、李小林及孙隽在紫金集团任职,董事王海涛同时在公司实际控制人国资集团任职。除前述关系外,公司董事、监事、高级管理人员相互间及与控股股东、实际控制人间不存在关联关系。

**董事、监事、高级管理人员薪酬管理信息:**

公司董事和监事的薪酬由股东大会决定,高级管理人员的薪酬方案由董事会决定,公司董事、监事和高级管理人员的薪酬按照上级部门相关政策、公司薪酬考核制度执行,根据年度绩效完成情况考核确定报酬,与岗位和绩效挂钩。公司外部董事、外部监事不在公司领取薪酬,独立董事薪酬参照行业水平及公司实际情况确定。报告期内,公司实际发放的董事、监事及高级管理人员(含离任)的薪酬总额 662.42 万元。

**(二) 持股情况**

单位:股

姓名	职务	期初持普通股股数	数量变动	期末持普通股股数	期末普通股持股比例%	期末持有股票期权数量
合计	-	0	0	0	0%	0

**(三) 变动情况**

信息统计	董事长是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	总经理是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	董事会秘书是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
	财务总监是否发生变动	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

姓名	期初职务	变动类型(新任、换届、离任)	期末职务	变动原因
齐世洁	董事	离任	无	工作安排
毕胜	无	新任	董事	补选

**本年新任董事、监事、高级管理人员简要职业经历:**

详见本节“一、董事、监事、高级管理人员情况”之“(四)现任董事、监事和高级管理人员的简要工作经历”。

**(四) 现任董事、监事和高级管理人员的简要工作经历**

董事简历如下:



1、步国甸，男，1959年9月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，正高级经济师，律师资格。先后在长航南京物资供应站、中燃总公司、中国人民银行南京分行工作，历任公司总经理助理、副总裁、董事、总裁等职务。现任本公司党委书记、董事长。

2、王海涛，男，1961年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级经济师。历任南京晨光机械厂工程师、团委书记，共青团南京市委常委、研究室主任、办公室主任，南京市信托投资公司经理、副总经理，南京市国际信托投资公司副总经理、党委委员，南京市投资公司总经理，南京紫金投资控股有限责任公司董事长，国资集团董事长、副总经理、总经理。现任国资集团董事长，紫金集团董事长，本公司副董事长。

3、李剑锋，男，1965年10月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级经济师。历任江苏教育学院人事处副主任科员、团委干事，本公司上海业务部副经理、上海业务部副经理（主持工作）、投资部副经理（主持工作）、连云港营业部经理、证券投资部经理、研究发展部经理、党委委员、副总裁，南京证券党委委员、富安达基金总经理。现任本公司党委副书记、董事、总裁。

4、陈峥，女，1968年5月出生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士，高级经济师。历任上海星火制浆造纸厂技术员、助理工程师，南京市国际信托投资公司信托部经理，国资集团金融资产部经理、总经理助理、副总经理，南京紫金投资控股有限责任公司副总经理，紫金集团副总经理，紫金信托董事、总裁。现任紫金集团董事、总经理，紫金信托董事长，本公司董事。

5、肖玲，女，1976年1月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，本科。先后在南京医药股份有限公司证券部、南京医药集团有限责任公司资产管理部工作，历任江苏恒生工贸实业有限公司经理助理，南京医药产业（集团）有限公司证券事务部经理助理、证券事务部副经理，新工集团投资规划部副经理、投资规划部总经理。现任新工集团投资发展部总经理，本公司董事。

6、毕胜，男，1973年7月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，经济师。历任南京新街口百货商店股份有限公司干事、平安保险江苏分公司（产险）文员、南京新街口百货商店股份有限公司投资部部长助理、投资部部长、董事会办公室主任，江苏凤凰置业投资股份有限公司董事会秘书。现任江苏凤凰置业投资股份有限公司副总经理、董事会秘书，本公司董事。

7、代士健，男，1977年9月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。历任南京汽车集团有限公司证券部法律事务员，江苏现代资产管理顾问有限公司投行一部副经理，交通集团投资发展部、资本运营部、法律事务部等部门助理、副经理、经理。现任交通集团董事会秘书、综合办公室主任，本公司董事。

8、李小林，男，1961年11月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，



正高级经济师。历任南京市投资公司高级项目经理、投资部副经理、资产部经理、副总经理、总经理，紫金集团纪委书记。现任紫金集团董事、副总经理，紫金资管董事长，本公司董事。

9、孙隽，女，1980年3月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。历任南京国有资产处置有限公司业务部助理项目经理，国资集团投资管理部助理业务主管、业务主管、经理助理，紫金集团投资管理部副总经理。现任紫金集团职工代表监事、投资管理部总经理，本公司董事。

10、吴斐，男，1984年9月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，律师。历任金东纸业（江苏）股份有限公司法务主管，哈尔滨电机厂（镇江）有限责任公司人力资源部部长、法务部部长、党委组织部部长、南京钢铁股份有限公司风险控制部副部长。现任南京钢铁股份有限公司风险控制部联席部长，本公司董事。

11、李心丹，男，1966年4月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士，教授、博士生导师。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授，南京大学工程管理学院教授、博士生导师、副院长、院长，曾为耶鲁大学访问学者。现任南京大学—牛津大学金融创新研究院院长、教授，本公司独立董事。

12、陈传明，男，1957年9月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士，教授、博士生导师。历任南京市铁心桥公社大队会计，中国社会科学院世界经济与政治研究所研究实习员，南京大学管理学系教师、系主任、商学院副院长、管理学院院长、商学院党委书记。现任南京大学商学院教授，本公司独立董事。

13、孙文俊，男，1966年10月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士研究生，一级律师。历任江苏省供销合作社总社科员、副科长，江苏金达律师事务所业务部主任，江苏致邦律师事务所主任。现任南京工业大学法学院教授，江苏致邦律师事务所律师，本公司独立董事。

14、张宏，男，1960年5月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级经济师。先后为中国人民解放军武汉军区空军第21团战士，北京618厂工人，历任中国建设银行信托投资公司证券部副总经理、国际业务部副总经理，北京国利能源投资有限公司副总经理，华澳国际信托有限公司监事长。现任华澳国际信托有限公司董事长，本公司独立董事。

15、李明辉，男，1974年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，博士，注册会计师（非执业），教授、博士生导师。历任厦门大学会计系讲师、副教授，南京大学会计学系副教授。现任南京大学会计学系教授，本公司独立董事。

监事简历如下：

1、陈晏，女，1960年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级经济师。曾作为知青下乡，历任南京丝织厂工程师、厂长助理，公司直属营业部副经



理、直属营业部经理、南京大钟亭营业部经理、经纪业务管理部经理、总经理、副总裁。现任本公司党委副书记、纪委书记、监事会主席。

2、黄涛，女，1972年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，本科。先后在南京造漆厂老色漆车间、杭州经营部工作，历任南京天龙股份有限公司财务部科员，南京龙华汽车涂料有限公司财务部科员，南京化学工业总公司（原南京化工局）财务部科员，南京化建产业（集团）有限公司财务部部长助理，新工集团财务管理部副经理。现任新工集团财务管理部总经理，本公司监事。

3、吴捷，女，1969年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。历任宿迁市水产技术指导站水产技术员，宿迁市水产局人事科干事，南京市老山林场党群部副主任、纪委副书记，南京市山西路百货大楼财务部经理助理、监察审计室副主任，南京农垦产业（集团）有限公司党群部人力资源主管、资产运营部副经理、资产运营部经理、总经理助理。现任南京农垦产业（集团）有限公司副总经理，本公司监事。

4、周坚宁，女，1959年4月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，大专，高级会计师。历任江南光学仪器厂财务科会计员，南京市仪器仪表工业公司财务处副主任科员、主任科员、会计师，南京长江发展股份有限公司投资部科长、审计监察处副处长、审计监察处处长、计划财务部经理、副总会计师、总会计师、副总经理，曾兼任南京市高级会计师评审委员会执行评委。现任南京长江发展股份有限公司党委副书记、总经理，本公司监事。

5、穆康，男，1974年3月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。历任公司直属证券营业部、南京大厂证券营业部、南京建康路证券营业部基层员工、镇江中山东路证券营业部总经理助理，连云港通灌南路证券营业部副总经理、总经理、连云港分公司总经理、经纪业务管理总部总经理。现任本公司职工代表监事、信用交易部总经理。

6、胡晨顺，男，1972年1月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，本科。历任原南京市白下区日用杂品公司会计，公司南京城北证券营业部业务员、交易员、计划财务部总账会计、张家港步行街证券营业部总经理助理、杭州庆春东路证券营业部副总经理，杭州新塘路证券营业部总经理、稽核部总经理。现任本公司职工代表监事、监察室主任。

7、闻长兵，男，1970年1月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。先后在中国建设银行连云港分行、中国建设银行江苏信托投资公司连云港办事处工作，历任公司连云港通灌南路证券营业部市场部经理、总经理助理、副总经理、连云港墟沟中华西路证券营业部副总经理、总经理。现任本公司职工代表监事、连云港分公司总经理。

高级管理人员简历如下：

1、李剑锋，见董事部分。

2、夏宏建，男，1973年10月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，





金融理财师。历任公司连云港证券营业部副总经理(主持工作)、南京大厂证券营业部总经理、南京大钟亭证券营业部总经理、资产管理部总经理、证券投资部总经理、业务总监兼宁夏管理总部总经理、业务总监兼营销管理总部总经理、总裁助理。现任本公司党委委员、副总裁。

3、秦雁，男，1973年10月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级经济师。历任公司南京中山东路证券营业部员工、研究发展部研究员、研究发展部经理助理、研究所副所长及所长、投资管理总部总经理、总裁助理。现任本公司党委委员、副总裁，兼任本公司金融衍生品部总经理、固定收益总部总经理。

4、黄锡成，男，1968年4月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，律师资格。历任江苏省建设委员会政策法规处科员、副主任科员、主任科员，中国证监会南京特派办综合处主任科员、副处长，江苏证监局上市公司监管二处副处长(主持工作)及处长、上市公司监管一处处长。2012年4月至2016年6月期间，任中国证监会第四、五届并购重组审核委员会委员。现任本公司党委委员、副总裁。

5、江念南，男，1965年8月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士，高级工程师。历任南京监狱技术科工程师、副科长，南京国际信托投资公司证券部工程师，公司电脑中心工程师、副总经理、电脑中心总经理、技术总监。现任本公司党委委员、总工程师、技术总监、信息技术总部总经理。

6、邱楠，男，1967年2月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士。历任南京市秦淮区商业局工委办公室干事、局团委书记，公司发行部副经理、投资银行一部副经理、研究发展部副经理、投资银行一部经理、办公室主任、董事会办公室主任、巨石创投董事长。现任本公司党委委员、副总裁、董事会秘书。

7、刘宁，女，1967年11月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，高级会计师、高级审计师。历任南京市审计局金融审计处科员、副主任科员、主任科员，公司计划财务部副总经理、财务负责人、计划财务部总经理、财务总监。现任本公司财务总监。

8、校坚，男，1973年12月出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，硕士，律师资格。先后在江苏泰和律师事务所、深圳证券交易所工作，历任华泰证券股份有限公司研究员，本公司法律顾问、资产管理部副总经理、风险管理部副总经理、风险管理部总经理、合规管理部总经理、合规总监。现任本公司合规总监、合规管理部总经理。

9、赵贵成，男，1964年4月1日出生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，本科，高级经济师。先后在江苏省电子元器件工业公司、江苏省电子工业厅及江苏省电子器材公司工作，历任公司南京鸿利证券营业部副经理、南京大厂证券营业部经理、常熟吉祥商城证券营业部总经理、西北证券托管组福州华林路证券营业部托管小组组长、经纪业务管理部总经理、营销管理总部总经理、期货IB业务部总经理、信用交易管理部总经理、





业务总监兼任宁夏分公司总经理、风险管理部总经理。现任本公司首席风险官。

### （五）董事、监事和高级管理人员任职情况

#### 1、在股东单位任职情况

姓名	股东单位名称	所担任职务	任职期间
王海涛	南京紫金投资集团有限责任公司	董事长	2012.6 至今
陈 峥	南京紫金投资集团有限责任公司	董事、总经理	2013.6 至今
	南京紫金信托有限责任公司	董事长	2015.6 至今
李小林	南京紫金投资集团有限责任公司	董事、副总经理	2014.5 至今
	南京紫金资产管理有限公司	董事长	2014.12 至今
孙 隽	南京紫金投资集团有限责任公司	投资管理部总经理、职工监事	2012.8 至今
肖 玲	南京新工投资集团有限责任公司	投资发展部总经理	2015.5 至今
代士健	南京市交通建设投资控股(集团)有限责任公司	董事会秘书、综合办公室主任	2014.2 至今
吴斐	南京钢铁股份有限公司	风险控制部副部长、联席部长	2014.8 至今
黄 涛	南京新工投资集团有限责任公司	财务管理部总经理	2015.5 至今
吴捷	南京农垦产业(集团)有限公司	副总经理	2015.6 至今
周坚宁	南京长江发展股份有限公司	董事、总经理	2016.3 至今

#### 2、在其他单位任职情况

姓名	其他单位名称	所担任职务	任职期间
王海涛	南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司	董事长	2013.6 至今
	南京金融城建设发展股份有限公司	董事长	2011.5 至今
	南京国资混改基金有限公司	董事长	2016.4 至今
	紫金财产保险股份有限公司	董事	2009.5 至今
	利安人寿保险股份有限公司	董事	2011.8 至今
	南京市产业发展基金有限公司	董事长	2017.1 至今
	中国东方航空江苏有限公司	董事	2008.2 至今
	南京禄口国际机场有限公司	副董事长	2007.1 至今
	中国国投高新产业投资有限公司	董事	2016.1 至今
李剑锋	宁夏股权托管交易中心(有限公司)	董事长	2015.6 至今
陈峥	南京银行股份有限公司	董事	2017.7 至今
肖 玲	金陵药业股份有限公司	董事	2014.6 至今
	中航工业南京轻型航空动力有限公司	董事	2012.10 至今
	瑞恒医药科技投资有限责任公司	董事	2013.1 至今
毕胜	江苏凤凰置业投资股份有限公司	副总经理、董事会秘书	2013.10 至今
李小林	南京国有资产处置有限公司	董事长	2011.12 至今
	南京华润热电有限公司	董事	2013.1 至今
	华能南京燃机发电有限公司	董事	2010.1 至今
	华能南京金陵发电有限公司	董事	2005.2 至今
	华能金陵燃机热电有限公司	董事	2013.10 至今
	南京禄口国际机场有限公司	董事	2013.1 至今
	华能南京热电有限公司	董事	2013.12 至今
孙隽	南京市高新技术风险投资股份有限公司	董事	2013.4 至今



	南京紫金投资信用担保有限公司	董事	2012.10 至今
	南京联合产权(科技)交易所有限公司	董事	2012.10 至今
	南京股权托管交易中心有限公司	董事	2015.12 至今
	南京国资绿地金融中心有限公司	董事	2009.9 至今
	南京紫金融资租赁有限责任公司	董事	2016.4 至今
	江苏紫金农村商业银行股份有限公司	董事	2018.1 至今
吴斐	亚东复星亚联投资有限公司	监事	2015.6 至今
	江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司	监事	2016.11 至今
	江苏南钢钢材现货贸易有限公司	监事	2016.11 至今
	江苏南钢钢材加工配送有限公司	监事	2016.11 至今
	上海金益融资租赁有限公司	监事	2016.3 至今
	南京鑫荣人力资源有限公司	监事	2016.2 至今
	南京金业康物业服务有限公司	监事	2017.3 至今
	南京南钢特钢长材有限公司	监事	2018.1 至今
	江苏南钢环宇贸易有限公司	监事	2018.1 至今
陈传明	南京大学商学院	教授	2006.11 至今
	昆山新莱洁净应用材料股份有限公司	独立董事	2014.11 至今
	协鑫集成科技股份有限公司	独立董事	2016.3 至今
	南京钢铁股份有限公司	独立董事	2016.5 至今
	华泰证券股份有限公司	独立董事	2016.3 至今
	上海德汇集团有限公司	独立董事	2017.7 至今
李心丹	南京大学-牛津大学金融创新研究院	教授、院长	2015.6 至今
	永丰银行(中国)有限公司	独立董事	2014.8 至今
	弘业期货股份有限公司	独立董事	2012.6 至今
	南方基金管理股份有限公司	独立董事	2013.7 至今
	千百度国际控股有限公司	独立非执行董事	2011.8 至今
	利得科技有限公司	独立董事	2016.6 至今
	江苏银行股份有限公司	监事	2017.4 至今
	山金金控资本管理有限公司	董事	2015.2 至今
孙文俊	南京工业大学法学院	教授	2017.6 至今
	江苏致邦律师事务所	律师	2000.9 至今
	南京卓成润佳财富管理有限公司	董事	2013.10 至今
	能拓电力股份有限公司	监事会主席	2017.2 至今
张宏	华澳国际信托有限公司	董事长	2014.11 至今
	北京融达投资有限公司	董事	2016.8 至今
李明辉	南京大学商学院	教授	2009.12 至今
	常柴股份有限公司	独立董事	2015.3 至今
	宝胜科技创新股份有限公司	独立董事	2014.12 至今
	江苏法尔胜股份有限公司	独立董事	2015.4 至今
	协鑫智慧能源股份有限公司	独立董事	2017.8 至今
黄涛	南京轨道交通系统工程有限公司	监事会主席	2013.10 至今
	南京邦盛新工股权投资基金管理有限公司	监事	2016.7 至今
吴捷	南京老山营养保健品有限公司	董事	2013.10 至今



	南京农垦出租汽车有限责任公司	董事	2013.11 至今
周坚宁	武宁长宁林业科技开发有限公司	执行董事	2013.7 至今
	南京长江联合贸易有限公司	董事长	2016.7 至今
	南京长江投资产业有限责任公司	董事长、总经理	2017.3 至今
	南京九通科技有限公司	董事长	2016.12 至今
夏宏建	江苏股权交易中心有限责任公司	董事	2013.5 至今
刘 宁	富安达基金管理有限公司	监事会主席	2011.4 至今
	南证期货有限责任公司	监事会主席	2015.10 至今
	南京巨石创业投资有限公司	监事	2012.4 至今
校 坚	南证期货有限责任公司	董事	2015.6 至今
	南京巨石创业投资有限公司	董事	2012.4 至今
赵贵成	宁夏股权托管交易中心（有限公司）	监事会主席	2015.6 至今
	南证期货有限责任公司	董事	2014.6 至今
	宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	执行董事	2016.5 至今
	南京巨石创业投资有限公司	董事	2017.5 至今

#### （六）董事会专门委员会人员构成情况

公司董事会下设合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会及审计委员会等三个专门委员会。截至本报告签署日，各专门委员会的人员构成情况如下：

专门委员会	人员构成
合规与风险管理委员会	主任委员：王海涛（董事） 委员：李剑锋（董事）、陈峥（董事）、李小林（董事）、肖玲（董事）、毕胜（董事）、吴斐（董事）
薪酬与提名委员会	主任委员：孙文俊（独立董事） 副主任委员：步国甸（董事） 委员：代士健（董事）、陈传明（独立董事）、李心丹（独立董事）
审计委员会	主任委员：李明辉（独立董事） 委员：张宏（独立董事）、孙隽（董事）

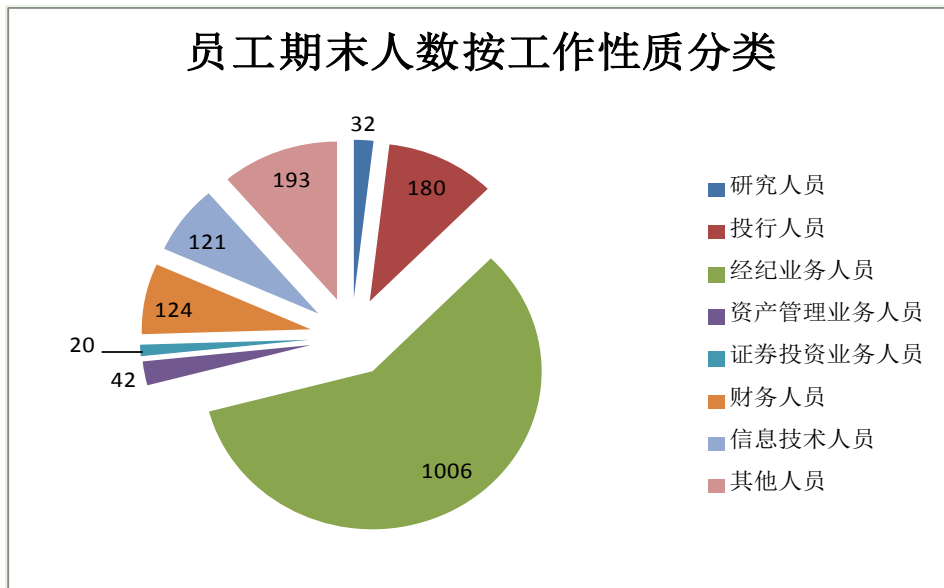
## 二、 员工情况

### （一）在职员工（母公司及主要子公司）基本情况

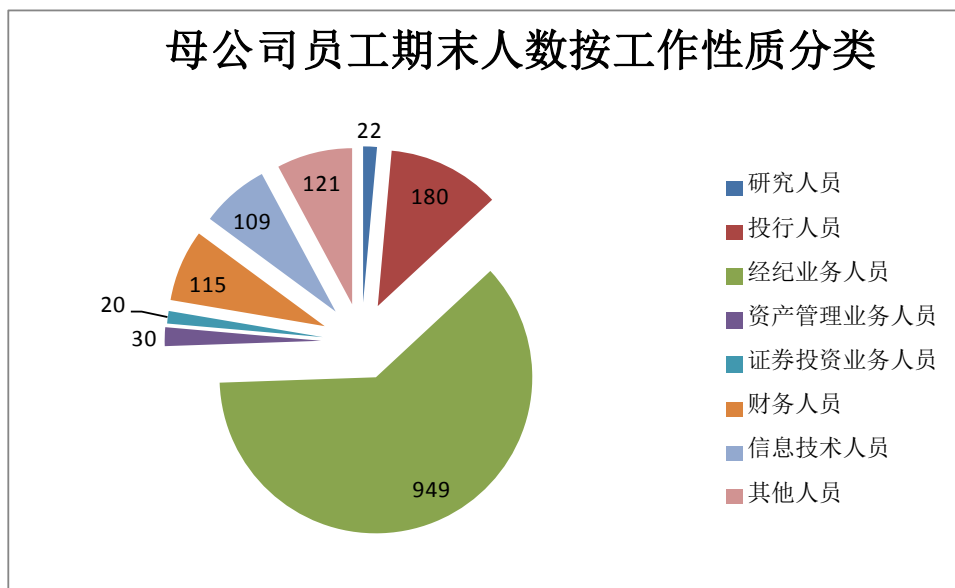
截至报告期末，公司及子公司员工总数为 1,718 人，其中，母公司 1,546 人，子公司南证期货 138 人，巨石创投 12 人，宁夏股权交易中心 22 人。截至报告期末，公司及子公司员工构成情况如下：

按工作性质分类	期初人数	期末人数
研究人员	36	32
投行人员	174	180
经纪业务人员	1,000	1,006
资产管理业务人员	37	42
券投资业务人员	17	20
财务人员	118	124

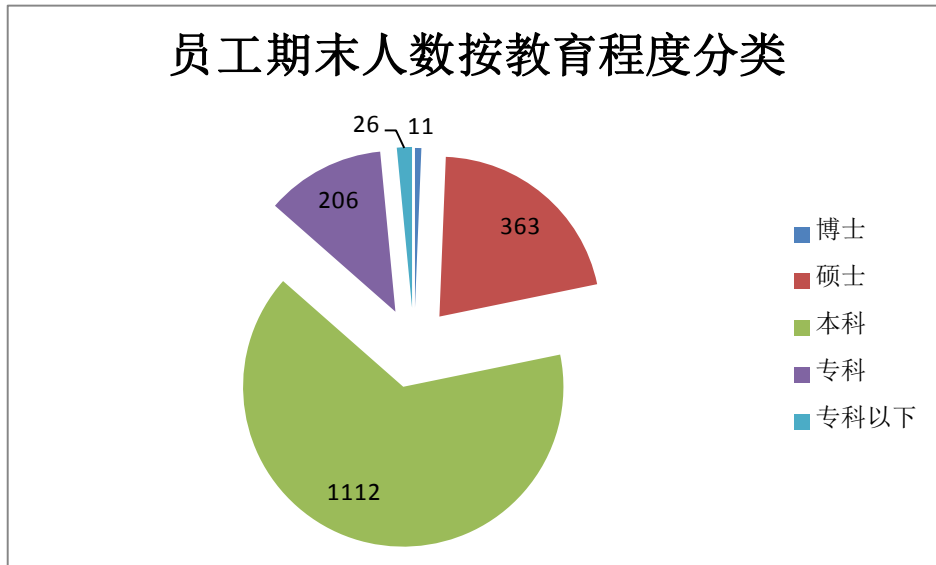
信息技术人员	103	121
其他	181	193
<b>员工总计</b>	<b>1,666</b>	<b>1,718</b>



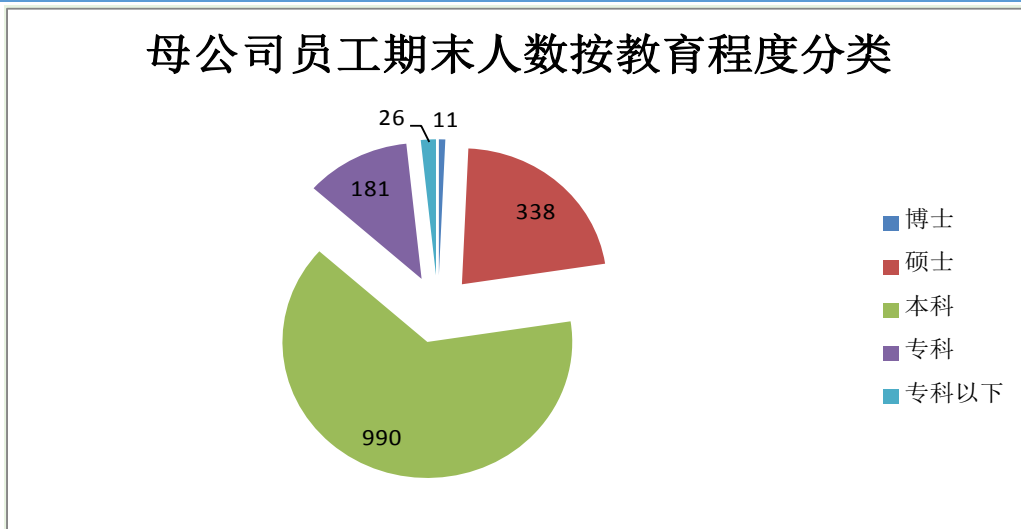
人员构成类别	期初人数 (母公司)	期末人数 (母公司)
研究人员	27	22
投行人员	174	180
经纪业务人员	940	949
资产管理业务人员	28	30
证券投资业务人员	16	20
财务人员	109	115
信息技术人员	89	109
其他人员	120	121
<b>员工总计</b>	<b>1,503</b>	<b>1,546</b>



按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	10	11
硕士	357	363
本科	1,042	1,112
专科	225	206
专科以下	32	26
员工总计	1,666	1,718



教育程度类别	期初人数（母公司）	期末人数（母公司）
博士	10	11
硕士	343	338
本科	931	990
专科	188	181
专科以下	31	26
员工总计	1,503	1,546





(二) 员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：

公司根据市场化原则，建立具备市场竞争力的薪酬机制。公司员工薪酬主要由基本工资（基础薪酬）、绩效工资和特殊岗位津贴、绩效奖金、福利性津贴、社会保险和公积金、企业年金、补充医疗保险等组成。基本工资（基础薪酬）、绩效工资与岗位责任相适应，与个人业绩相联系，公司依据业务发展需要对个别业务岗位给予特殊岗位津贴；绩效奖金与公司经济效益和目标任务的完成情况挂钩；福利性津贴包括法定节日福利、福利性补贴和公司重大事项奖励等；按照规定为员工缴纳各项法定社会保险及公积金，并按属地化原则进行管理。报告期内，公司承担费用的离退休人数为 55 人。

公司重视人才培养，大力加强员工培训，为员工职业生涯的可持续发展提供有力支撑。报告期内，公司制订并组织实施了年度培训计划，其中，面授和在线培训十多场，共计培训 9,800 多人次。公司层面集中组织的新员工入职培训、中层后备干部培训、分支机构协同业务培训等 10 多场，300 多人次。业务技术类培训、考试 20 余场，4,500 多人次参加了考试。报告期内，公司组织制作了 60 多门培训课程课件，并安排员工参加了证券从业人员后续教育培训及考试，通过行业动态、监管要求、专业技能等多方面学习培训不断推动员工职业技能提升，提高员工整体素质，从而适应行业快速发展要求。公司无核心员工。

### 三、 证券经纪人相关情况

截至报告期末，公司获准实施证券经纪人制度的分支机构共 86 家，公司签约证券经纪人共 539 名。

公司建立了较为完善的证券经纪人管理组织架构。经纪业务管理总部作为归口管理部门，与其他部门协同配合，负责证券经纪人的日常管理；合规管理部门对证券经纪人管理、证券经纪人的执业行为进行合规检查，防范合规风险；稽核部对证券经纪人管理情况进行稽核，实施事后监控；风险管理部等部门通过系统对证券经纪人所招揽客户的交易情况进行监控，控制风险；营销管理中心和相关分支机构对证券经纪人客户进行回访，发现和控制证券经纪人违规风险；各分支机构在公司的指导下负责证券经纪人具体管理工作。

公司不断完善证券经纪人管理制度和内控机制，加强经纪人执业行为管理。严格执行证券经纪人的招录及资格管理，明确证券经纪人授权范围和业务职责，明确告知证券经纪人在营销过程中的禁止行为，并要求其签订承诺书。公司对证券经纪人相关信息进行公示，确保投资者在营业时间内能够通过现场、电话、互联网等方式随时查询证券经纪人的姓名、代理权限、代理期限及证券经纪人证书编号等信息。对于证券经纪人招揽的客户，要求客户本人





签署《证券经纪人客户告知书》，详细告知其与证券经纪人的关系、证券经纪人的授权范围、禁止行为、投诉方式等内容，明确双方权责，保障客户合法权益。同时，公司对证券经纪人招揽的客户进行抽查跟踪回访，及时了解客户情况，妥善处理客户咨询和投诉，监督证券经纪人的执业行为。

公司建立了证券经纪人执业考核机制。公司根据《证券经纪人绩效考核管理办法》等制度规定，对证券经纪人进行考核，考核内容包括执业合规考核和业绩考核两部分。证券经纪人获得的报酬按业绩考核计算所得的报酬基数与证券经纪人执业合规情况考评得分所确定。通过建立健全考核机制，促使证券经纪人强化合规执业意识和理念，更有效地管控其执业行为。



## 第九节 公司治理及内部控制

事项	是或否
年度内是否建立新的公司治理制度	√是 □否
董事会是否设置专门委员会	√是 □否
董事会是否设置独立董事	√是 □否
投资机构是否派驻董事	√是 □否
监事会对本年监督事项是否存在异议	□是 √否
管理层是否引入职业经理人	□是 √否
会计核算体系、财务管理、风险控制及其他重大内部管理制度本年是否发现重大缺陷	□是 √否
是否建立年度报告重大差错责任追究制度	√是 □否

### 一、 公司治理

#### (一) 制度与评估

##### 1、 公司治理基本状况

公司根据《公司法》、《证券法》以及《证券公司治理准则》等规定，建立了包括股东大会、董事会、监事会、管理层等在内的法人治理结构。董事会由 15 名董事组成，其中包括 5 名独立董事。董事会下设合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会及审计委员会三个专门委员会，其中，薪酬与提名委员会、审计委员会中独立董事人数占多数，且均由独立董事担任主任委员。董事会严格按照相关监管规定，在《公司章程》规定职责范围和股东大会授权权限内开展工作；管理层对董事会负责并报告工作，管理层能够严格、高效地执行董事会决议；监事会作为内部监督机构，履行对董事、高级管理人员行为的监督及对公司财务的检查职责。公司股东大会、董事会、监事会和管理层之间权责分工明确、运作规范，相互协调、制衡，各司其职、各负其责，公司治理较为完善高效。

公司在《公司章程》中规定了股东大会、董事会及专门委员会、监事会和管理层的职责和权限，制定了《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《监事会议事规则》、董事会下设各专门委员会的实施细则、《总裁工作细则》、《董事会秘书工作制度》、《独立董事制度》、《关联交易管理办法》、《对外投资管理制度》等制度，并就年报编制和报送、董监事和高级管理人员绩效考核和薪酬管理等事项制定了专门的管理制度。报告期内，为规范关联交易管理，完善公司债券信息披露程序和要求，公司制定了《〈关联交易管理办法〉实施细则（试行）》及《公司债券信息披露管理细则（试行）》等制度，对相关职责分工及具体要求进行了明确。



## 2、公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

公司对于股东，不论持股比例多少，均保护其合法权益的行使和不受侵犯。

《公司章程》规定，公司的股份采取股票的形式发行。公司股份的发行，实行公平、公正的原则，同种类的每一股份应当具有同等权利。同次发行的同种类股票，每股的发行条件和价格应当相同；任何单位或者个人所认购的股份，每股应当支付相同价额。《公司章程》明确规定了公司股东享有的权利，其中包括：依照其所持有的股份份额获得股利和其他形式的利益分配；依法请求、召集、主持、参加或者委派股东代理人参加股东大会，并行使相应的表决权；对公司的经营进行监督，提出建议或者质询；依照法律、行政法规及本章程的规定转让、赠与或质押其所持有的股份；查阅《公司章程》、股东名册、公司债券存根、股东大会决议、董事会会议决议、监事会会议决议、财务会计报告；公司终止或者清算时，按其所持有的股份份额参加公司剩余财产的分配；对股东大会作出的公司合并、分立决议持异议的股东，要求公司收购其股份；法律、行政法规、部门规章或本章程规定的其他权利。

《公司章程》进一步规定了上述权利的实现途径、方式方法等内容。

为保证公司股东充分行使参与权和表决权，《公司章程》和《股东大会议事规则》详细规定了股东大会的召集、提案和通知、召开、决议的执行等事项。

为保证公司股东充分行使知情权，《公司章程》规定，股东提出查阅《公司章程》、股东名册、公司债券存根、股东大会决议、董事会会议决议、监事会会议决议、财务会计报告等资料的，应当向公司提供证明其持有公司股份的种类以及持股数量的书面文件，公司经核实股东身份后按照股东的要求予以提供。为保证公司股东充分行使质询权，《公司章程》规定，董事、监事、高级管理人员在股东大会上应就股东的质询和建议作出解释或说明。

## 3、公司重大决策是否履行规定程序的评估意见

对于对外投融资、重要人事变动、关联交易等事项，公司严格按照法律法规、监管规定、《公司章程》及公司相关规章制度规定的权限和程序，提交董事会、监事会或股东大会审议决策。

## 4、公司章程的修改情况

报告期内，经 2017 年第二次临时股东大会审议通过，公司对《公司章程》进行了修订，并将修订内容中涉及的章程重要条款报监管部门审核。根据最新监管要求和监管部门的反馈意见，公司对 2017 年第二次临时股东大会审议通过的《公司章程》修订内容进行了完善，完善后的《公司章程》修订内容已经 2018 年第一次临时股东大会审议通过。修订内容主要



包括：将党建工作要求写入《公司章程》；在《公司章程》中明确公司可设立私募投资基金子公司从事私募投资基金业务；对《公司章程》中关于合规管理、全面风险管理等方面的内容进行完善。详见公司于2017年12月27日在全国股转系统官方网站披露的《关于修订公司章程的公告》（公告编号：2017-068）。《公司章程》上述修订内容中涉及的重要条款变更已报江苏证监局审核。

## （二） 三会运作情况

### 1、 三会召开情况

会议类型	报告期内会议召开的次数	经审议的重大事项（简要描述）
董事会	6	审议并通过公司董事会工作报告、定期报告、内部控制、合规风控、董事高管考核、对外投资、关联交易、利润分配、变更会计政策、修订公司章程、申请上市等事项。
监事会	4	审议并通过公司监事会工作报告、定期报告、内部控制、合规风控、监事考核、变更会计政策等事项。
股东大会	4	审议并通过公司董事会工作报告、监事会工作报告、定期报告、董事监事高管考核、对外投资、关联交易、利润分配、变更会计政策、修订公司章程、申请上市等事项。

具体如下：

#### （1） 股东大会会议情况及决议内容

报告期内，公司共召开4次股东大会会议，其中2次以现场方式召开，2次以通讯方式召开，会议情况如下：

会议届次	会议时间	会议方式	会议议案及表决情况
二〇一七年第一次临时股东大会	2017.1.20	现场	审议并通过： 1、关于公司首次公开发行股票并上市后三年内稳定股价预案的议案 2、关于公司首次公开发行股票并上市后前三年股东分红回报规划的议案 3、关于公司首次公开发行股票并上市摊薄即期回报影响分析及填补即期回报措施的议案 4、关于公司首次公开发行股票募集资金使用方向及可行性的议案 5、关于公司董事及高级管理人员对公司首次公开发行股票摊薄即期回报填补措施得到切实履行作出承诺的议案 6、关于公司就首次公开发行股票并上市事项出具有关承诺并提出相应约束措施的议案 7、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案 8、关于制定首次公开发行股票并上市后适用的《南京证券股份有限公司股东大会议事规则》的议案 9、关于制定首次公开发行股票并上市后适用的《南京证券股份有



			<p>限公司关联交易管理办法》的议案</p> <p>10、关于制定首次公开发行股票并上市后适用的《南京证券股份有限公司募集资金管理办法》的议案</p> <p>11、关于制定首次公开发行股票并上市后适用的《南京证券股份有限公司股东大会网络投票实施细则》的议案</p> <p>12、关于修订公司章程的议案</p>
二〇一六年年度股东大会	2017. 5. 18	现场	<p>审议并通过:</p> <p>1、二〇一六年度董事会工作报告</p> <p>2、二〇一六年度监事会工作报告</p> <p>3、独立董事二〇一六年度工作报告</p> <p>4、二〇一六年度财务报告</p> <p>5、二〇一六年度年度报告及摘要</p> <p>6、二〇一六年度利润分配方案</p> <p>7、关于聘请二〇一七年度审计机构的议案</p> <p>8、关于审议关联交易的议案</p> <p>9、关于预计公司二〇一七年度日常性关联交易的议案</p> <p>10、二〇一六年度财务情况、合规情况的专项说明</p> <p>11、关于二〇一六年度董事薪酬及考核情况的专项说明</p> <p>12、关于二〇一六年度监事薪酬及考核情况的专项说明</p> <p>13、关于二〇一六年度高管人员薪酬及考核情况的专项说明</p> <p>14、关于选举公司第二届董事会董事的议案</p>
二〇一七年第二次临时股东大会	2017. 10. 10	通讯	<p>审议并通过:</p> <p>1、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案</p> <p>2、关于修订公司章程的议案</p> <p>3、关于确认董事补助标准的议案</p> <p>4、关于确认监事补助标准的议案</p>
二〇一七年第三次临时股东大会	2017. 11. 29	通讯	<p>审议并通过:</p> <p>1、关于南证期货有限责任公司增资的议案</p> <p>2、关于对富安达基金管理有限公司增资的议案</p>

## (2) 董事会会议情况及决议内容

报告期内，公司董事会共召开 6 次，均为现场会议。其中，第二届董事会第八次会议和第二届董事会第九次会议为定期会议，其余 4 次会议为临时会议。会议情况如下：

会议届次	会议时间	会议方式	会议议案及表决情况
第二届董事会第七次会议	2017. 3. 1	现场	<p>审议并通过:</p> <p>1、关于公司内部董事和全体高级管理人员 2016 年度述职考评情况的报告</p>
第二届董事会第八次会议	2017. 4. 26	现场	<p>审议并通过:</p> <p>1、二〇一六年度总裁工作报告</p> <p>2、二〇一六年度董事会工作报告</p> <p>3、董事会合规与风险管理委员会二〇一六年度工作报告</p> <p>4、董事会薪酬与提名委员会二〇一六年度工作报告</p> <p>5、董事会审计委员会二〇一六年度工作报告</p>



			<ul style="list-style-type: none"> <li>6、二〇一六年度财务报告</li> <li>7、二〇一六年度利润分配预案</li> <li>8、关于聘请二〇一七年度审计机构的议案</li> <li>9、二〇一六年度年度报告及摘要</li> <li>10、关于审议最近三年（2014年-2016年）财务会计报告的议案</li> <li>11、二〇一六年度合规报告</li> <li>12、二〇一六年度合规管理有效性评估报告</li> <li>13、二〇一六年度内部控制自我评价报告</li> <li>14、二〇一六年度风险管理与风险控制指标执行情况报告</li> <li>15、关于确定公司二〇一七年度风险指标体系的议案</li> <li>16、关于制定《南京证券股份有限公司落实全面风险管理要求工作方案》的议案</li> <li>17、关于修订《南京证券股份有限公司全面风险管理纲要》的议案</li> <li>18、关于确定公司二〇一七年度自营业务规模的议案</li> <li>19、关于确定公司二〇一七年度信用交易业务规模的议案</li> <li>20、关于审议关联交易的议案</li> <li>21、关于预计公司二〇一七年度日常性关联交易的议案</li> <li>22、关于二〇一六年度董事薪酬及考核情况的专项说明</li> <li>23、关于二〇一六年度高管人员薪酬及考核情况的专项说明</li> <li>24、关于选举第二届董事会董事的议案</li> <li>25、关于召开二〇一六年度股东大会的议案</li> </ul>
第二届董事会第九次会议	2017.8.24	现场	审议并通过： <ul style="list-style-type: none"> <li>1、二〇一七年半年度报告</li> <li>2、二〇一七年度中期合规报告</li> <li>3、二〇一七年上半年度风险管理与风险控制指标执行情况报告</li> <li>4、关于变更会计政策的议案</li> <li>5、关于选举第二届董事会合规与风险管理委员会委员的议案</li> </ul>
第二届董事会第十次会议	2017.9.19	现场	审议并通过： <ul style="list-style-type: none"> <li>1、关于公司最近三年及一期财务会计报告和内部控制报告的议案</li> <li>2、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案</li> <li>3、关于修订公司章程的议案</li> <li>4、关于确认董事补助标准的议案</li> <li>5、关于召开公司2017年第二次临时股东大会的议案</li> </ul>
第二届董事会第十一次会议	2016.11.4	现场	审议并通过： <ul style="list-style-type: none"> <li>1、关于南证期货有限责任公司增资的议案</li> <li>2、关于对富安达基金管理有限公司增资的议案</li> <li>3、关于对外捐赠的议案</li> <li>4、关于召开公司2017年第三次临时股东大会的议案</li> </ul>
第二届董事会第十二次会议	2017.12.25	现场	审议并通过： <ul style="list-style-type: none"> <li>1、关于修订《南京证券股份有限公司合规管理实施办法》的议案</li> <li>2、关于制定《南京证券股份有限公司高级管理人员合规性专项考核管理办法》的议案</li> </ul>





- |  |  |  |   |
|--|--|--|---|
|  |  |  | 3、关于对外捐赠的议案<br>4、关于修订公司章程的议案<br>5、关于召开公司 2018 年第一次临时股东大会的议案 |
|--|--|--|---|

**(3) 监事会会议情况及决议内容**

报告期内，公司监事会共召开 4 次会议，4 次均为现场会议，会议情况如下：

会议届次	会议时间	会议方式	会议议案
第二届监事会第四次会议	2017. 3. 1	现场	审议并通过： 1、关于公司相关监事 2016 年度述职考评情况的报告
第二届监事会第五次会议	2017. 4. 26	现场	审议并通过： 1、二〇一六年度监事会工作报告 2、二〇一六年度财务报告 3、关于公司《二〇一六年年度报告》及摘要的议案 4、二〇一六年度合规报告 5、二〇一六年度财务情况、合规情况的专项说明 6、关于修订《南京证券股份有限公司全面风险管理纲要》的议案 7、关于二〇一六年度监事薪酬及考核情况的专项说明
第二届监事会第六次会议	2017. 8. 24	现场	审议并通过： 1、二〇一七年半年度报告 2、关于变更会计政策的议案
第二届监事会第七次会议	2017. 9. 19	现场	审议并通过： 1、关于公司最近三年及一期财务会计报告和内部控制报告的议案 2、关于确认公司最近三年及一期关联交易的议案 3、关于确认监事补助标准的议案

**2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见**

公司严格按照法律法规、《公司章程》及相关议事规则的规定，依法召集、召开股东大会会议、董事会及专门委员会会议、监事会会议，相关会议的召集、召开及表决程序符合法律法规的要求以及《公司章程》有关规定。

**(三) 公司治理改进情况**

公司现有 15 名董事均取得了监管部门核准的任职资格。其中独立董事 5 名，非独立董事 10 名。4 名非独立董事系控股股东或实际控制人以外的其他股东推荐。公司股东通过所推荐的董、监事在董事会、监事会中对公司经营管理事项发表意见，依法在股东大会会议中对公司重大经营事项行使表决权，依法行使股东的其他权利，除前述情形外股东不存在直接参与公司经营管理的的情况。公司管理层未引入职业经理人。

**(四) 投资者关系管理情况**

公司按照法律、法规、监管规定及《公司章程》的规定，依法平等保护全体股东的参与权、知情权、表决权等各项合法权利。

公司制定了《投资者关系管理制度》、《信息披露事务管理制度》及《公司债券信息披露管理细则（试行）》等制度，规范和细化了投资者关系管理和信息披露工作程序。公司建立健全了与股东、债权人、潜在投资者等利益相关者的沟通交流机制，按规定做好信息披露工作，确保披露信息真实、准确、完整。公司通过协调和平衡股东、客户、债权人、员工及社会等各方利益，共同推动公司稳健发展。

**(五) 董事会下设专门委员会在本年度内履行职责时所提出的重要意见和建议**

报告期内，合规与风险管理委员会召开了 5 次会议，薪酬与提名委员会召开了 3 次会议，审计委员会召开了 4 次会议，议题主要涉及合规及全面风险管理报告及有关制度规则、内部控制、业务发展、对外投资、定期报告、董事提名、高管考核与薪酬等事项。各专门委员会严格按照《公司章程》及各委员会实施细则履行职责，依法合规运作，为董事会科学高效决策提供了有效支持。

**(六) 独立董事履行职责情况**

姓名	本年应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数
李心丹	6	5	1	0
陈传明	6	6	0	0
孙文俊	6	6	0	0
张宏	6	4	2	0
李明辉	6	4	2	0

**独立董事的意见：**

报告期内，独立董事按规定出席董事会及相关专门委员会会议、股东大会现场会议。独立董事就第二届董事会第八次会议审议的关联交易事项、董事提名及董事、高管人员薪酬考核、利润分配、聘请审计机构等事项发表了独立意见；就第二届董事会第十一次会议审议的南证期货增资及对富安达基金增资等事项发表了独立意见。报告期内，不存在独立董事对



董事会议案及其他议案提出异议的情形，不存在独立董事对公司有关建议未被采纳的情形。

### (七) 现任及离任董事报告期内出席董事会会议情况

董事姓名	是否 独立董事	报告期内 应参加董事会 会议次数	亲自出席次数(含 以电话方式出席)	委托 出席次数	缺席次数	投票表决 情况
步国旬	否	6	6	0	0	除根据规定应 回避表决事项 外,均为同意票
王海涛	否	6	4	2	0	同上
李剑锋	否	6	5	1	0	同上
陈 峥	否	6	3	3	0	同上
肖 玲	否	6	6	0	0	同上
毕 胜	否	4	4	0	0	同上
代士健	否	6	4	2	0	同上
李小林	否	6	5	1	0	同上
孙 隽	否	6	4	2	0	同上
吴 斐	否	6	6	0	0	同上
李心丹	是	6	5	1	0	同上
陈传明	是	6	6	0	0	同上
孙文俊	是	6	6	0	0	同上
张 宏	是	6	4	2	0	同上
李明辉	是	6	4	2	0	同上
齐世洁 (离任)	否	2	2	0	0	同上

### (八) 现任及离任监事报告期内出席监事会会议情况

监事姓名	报告期内应参加 监事会会议次数	亲自出席次数 (含以电话方式出席)	委托 出席次数	缺席 次数	投票表决情况
陈 晏	4	3	1	0	均为同意票
黄 涛	4	4	0	0	同上
吴 捷	4	3	1	0	同上
周坚宁	4	2	2	0	同上
穆 康	4	4	0	0	同上
胡晨顺	4	4	0	0	同上
闻长兵	4	2	2	0	同上

## 二、 内部控制

### (一) 监事会就年度内监督事项的意见

报告期内，公司监事会对所监督事项无异议。

监事会对董事会编制的年度报告书面审核意见为：公司年度报告的编制和审核程序符合相关法律、行政法规、中国证监会以及全国中小企业股份转让系统有限责任公司的规定和《公



公司章程》的要求，年度报告的内容能够真实、准确、完整地反映公司本年度的实际情况。

## （二） 公司保持独立性、自主经营能力的说明

公司严格按照相关法律法规以及《公司章程》的规定，规范运作，在业务、人员、资产、机构、财务等方面均独立于控股股东、实际控制人，具体如下：

（一）业务独立。公司独立拥有经营相关证券业务所需的资质，具有独立完整的业务经营系统和管理系统，依法独立开展业务，不存在依赖于控股股东、实际控制人的情形。

（二）人员独立。公司的劳动人事管理与股东单位分离。公司董监事、高级管理人员的选聘符合《公司法》、《证券法》以及中国证监会有关监管规定进行，公司高级管理人员不存在在控股股东、实际控制人任职或领取薪酬的情况。

（三）资产独立。公司的经营场所独立于控股股东、实际控制人及其控制的其他企业，公司合法拥有正常经营业务所需资产的所有权或使用权。公司不存在因资产或资金被控股股东、实际控制人占用而损害公司利益的情况。

（四）机构独立。公司的机构设置完整，运作规范。公司建立了较为完善和规范的法人治理结构，并建立了符合业务发展需求的内部组织机构，各部门的工作职责和分工明确，流程清晰。

（五）财务独立。公司财务独立于控股股东、实际控制人。公司建立了独立的财务会计核算体系和财务管理制度，设置了独立的财务部门，专门负责处理相关财务事项。公司依法独立纳税。公司独立在银行开立账户，不存在与其他单位共用银行账户的情况。

## （三） 对重大内部管理制度的评价

公司董事会对包括公司重大管理制度等在内的内部控制机制的建立和执行情况的评价报告如下：

### 一、重要申明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会责任。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。经营管理层负责企业内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，并对报告的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目的是保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进实现发展战略。由于内部控制存在固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或对控制政策和程序遵循的程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的



风险。

## 二、内部控制评价结论

根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定标准,于内部控制评价报告基准日,公司不存在财务报告内部控制重大缺陷。公司董事会认为,公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

根据公司非财务报告内部控制重大缺陷的认定标准,于内部控制评价报告基准日,公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷。

自内部控制评价报告基准日起至内部控制评价报告发出日止,未有影响内部控制有效性评价结论的因素发生。

## 三、内部控制评价工作情况

### (一) 评价程序和方法

1、准备阶段。实施工作动员,明确评估对象和范围。

2、实施阶段。开展自我评价工作,采取审阅制度流程、访谈、抽查业务台账、查看技术系统、穿行测试等方法,对公司内部控制设计和运行的有效性进行分析,对发现的缺陷及时督促整改。

3、报告阶段。汇总完成内控评价工作报告并予以披露。

### (二) 内部控制评价范围

公司按照风险导向原则确定纳入评价范围的主要单位、业务和事项以及高风险领域。内部控制评价的范围贯彻全面性和重要性原则,包括内部控制的设计和运行,重点关注经纪、信用交易、投资银行、自营、固定收益、资产管理、研究咨询、资金管理、财务管理及财务报告编制等高风险领域,围绕内部控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督对内部控制进行全面评价。

本次纳入评价范围的单位包括:母公司及3家子公司—巨石创投、南证期货和宁夏股权托管交易中心。上述纳入评价范围的单位、业务和事项以及高风险领域涵盖了公司经营的主要方面,不存在重大遗漏。

### (三) 内部控制评价的基本情况

#### 1、内部环境

##### (1) 法人治理结构

公司根据《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》等法律、法规和规范性文件的规定,建立了由股东大会、董事会、监事会和公司管理层组成的公司治理架构,形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和相互制衡机制。

公司董事会设立了合规与风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会三个专门委员会,并制订了相应的工作规则,明确了其权责、决策程序和议事规则。此外,为提高董



事会决策质量和监督职能, 本公司现任董事会成员中有五名独立董事, 符合监管要求。董事会严格按照相关监管规定, 在公司章程规定职责范围和股东大会授权权限内开展工作; 监事会作为内部监督机构, 履行对董事、高级管理人员行为的监督及对公司财务的检查职责; 管理层对董事会负责并报告工作, 管理层能够严格、高效地执行董事会决议。

### (2) 发展战略

公司坚持把握新时代机遇, 直面竞争挑战, 走出一条特色化、可持续的发展之路。结合自身特点和现阶段发展情况, 明确将南京证券建设为“规模适度、平台高效、业绩显著、特色鲜明”的一流现代金融企业战略目标; 将强化合规经营, 规范稳健运营作为发展的根本保证, 保持公司稳健规范发展的优良传统; 提出了目前阶段“转型”和“突破”的核心发展思路, 即: 严格履行投资者适当性管理的监管要求, 积极推进渠道、产品、服务和运营模式的转型, 推动大零售业务、大投行业务、投资业务和资产管理业务开展, 实现机制改革和资本市场布局的突破。

同时, 公司将进一步完善金融板块布局, 加强对控股和全资子公司的管理, 发挥母子子公司、子公司之间的协同效应, 形成整体合力, 努力提升经营业绩; 调整优化业务架构, 推进信息化建设, 加强人才队伍建设, 加快公司转型发展。

### (3) 人力资源

公司在人力资源管理中不断完善符合公司实际的招聘、录用、考核、晋升等劳动人事管理制度, 制定了劳动合同制实施办法、员工招录管理办法、员工证券业执业资格管理办法、员工休假、考勤管理办法、员工培训实施办法等一系列制度, 并结合市场情况不断完善薪酬激励机制, 吸引、留住优秀人才。为提升员工的工作能力和职业素养, 公司不断完善员工培训体系, 加强对员工的专业技能培训、职业道德教育以及合规知识培训。为防范人为操作风险和道德风险, 公司对风险较高的岗位, 采取垂直管理、强制休假、轮岗、离任稽核等管理措施, 控制和防范风险。

同时, 公司及时进行组织架构调整, 做好三级职责分解, 完善岗位设置, 开展定岗定编工作, 进一步夯实人力资源管理基础, 有效支撑公司战略实现及各项业务的有效开展。

### (4) 社会责任

公司遵纪守法, 合规经营, 高度重视社会责任, 以做到经济效益与社会效益、短期利益与长远利益、自身发展与社会发展相互协调为企业发展目标, 力争实现客户信赖、员工自豪、股东满意、社会尊重。

公司积极承担起社会责任, 并贯通到公司整个日常经营过程中。一是充分发挥大投行专业优势, 积极提供综合金融服务, 竭力支持中小企业发展, 为地方实体经济的发展与繁荣不断贡献力量。二是用心服务好广大投资者, 加大信息系统投入, 积极推动公司“金罗盘”移动理财终端、“阳光微厅”、投资顾问等系统的建设, 通过专业服务的提升, 把客户利益优先、维护投资者利益理念落到实处。三是认真履行社会责任, 贯彻党中央国务院打赢脱贫攻坚战





精神,通过资本扶贫、产业扶贫、公益扶贫等多种方式,助推国家级贫困县宁夏同心县脱贫攻坚。积极参与南京市“万名党员帮万户”活动,对江宁横山社区进行结对帮扶,投入帮扶资金近 60 万元。积极响应中国证券业协会号召,向山西省隰县午城镇寺坡村扶贫电站建设项目捐赠建设资金 75 万元。作为全国文明单位,与淮安市花桥村开展“城乡结对、文明共建”活动。蝉联“全国文明单位”荣誉称号,荣获“江苏省文明单位”、“南京市文明单位标兵”等荣誉称号。

#### (5) 企业文化

公司始终秉承“正统、正规、正道”的企业文化,贯彻“以制度治企、以制度管人、以制度办事”的经营管理理念,切实强化企业管理、业务开展、合规经营、风险防范等方面的制度建设,坚持“制度是保障、体系是基础、文化是根本”的合规建设方针和“合规创造价值,合规从高层做起”的合规理念,通过组织合规培训、开展思想政治教育活动等多种形式,加强合规文化建设,提升员工合规意识,营造了良好的企业文化氛围。

### 2、风险评估

2017 年,公司不断完善与公司战略发展相适应的全面风险管理体系,根据董事会确定的风险偏好实施风险控制,持续改进风险管理措施和流程,加强风险的识别、计量、监测、控制和报告各环节,塑造稳健审慎的风险管理文化。

#### (1) 市场风险

公司面临的市场风险是公司的持仓组合由于相关市场的不利变化而导致损失的风险。公司的市场风险主要源于权益类投资、固定收益类投资、衍生品投资等,主要集中于公司投资管理总部、固定收益总部和资产管理总部等业务部门。

公司根据内外部环境变化拟定市场风险管理政策和制度,对公司债券、股票、衍生品等各类投资品种的市场风险进行识别、评估,并通过建立风险价值 VAR、敏感性分析、情景分析和压力测试计量、评估和管理风险。报告期内,公司进一步加强市场风险管理,完善市场风险监控指标,利用市场风险计量模型,全面计量公司市场风险头寸及各维度组合的市场风险指标,密切关注所投资债券、股票等品种公允价值的波动幅度;对商品期权、股票 alpha 套利等新业务,建立风险监控和报告机制。

#### (2) 信用风险

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约或履约能力下降而为公司带来损失的风险。公司的信用风险主要来自融资融券类业务、股票质押回购交易、约定式购回交易、经纪业务代理客户买卖证券、固定收益投资、合同履行等方面。

公司董事会、经营管理层及风险控制委员会、风险管理职能部门、业务部门在各自的权限范围内履行相应的信用风险管理职责。公司主要采取加强客户征信管理、加强固定收益投资控制及强化合同管理等方式控制信用风险。通过建立交易对手评级、授信管理、限额管理、压力测试等管理机制,对股票质押回购业务重点关注和评估质押证券的折扣率及融资方还款



能力、信誉,通过业务有效的事前评估、及时提醒、强化审核等多种形式,加强与业务部门沟通,以确保信用风险的可控。

### (3) 操作风险

操作风险是指各项业务因经营模式选择不当或操作失误对公司造成的风险,如操作流程设计不当或矛盾,内部控制未落实等。操作风险涉及公司各项业务,包括经纪业务、自营业务、资产管理业务、投资银行业务等。

公司针对操作风险制订了管理办法及配套指引,通过健全的授权机制和岗位职责、规范化的制度流程、前中后台的有效牵制、员工持续培训、IT 系统建设和事后监督检查等手段综合管理操作风险。公司建立了操作风险事件及损失数据收集机制,针对操作风险损失事件实施信息数据收集与分析、整改、报告工作。

### (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。公司主要通过完善财务资金管理制度、建立净资本预警机制、动态监控等措施控制流动性风险。

公司进一步修订了流动性风险管理相关制度,明确了流动性管理的组织架构、风险管理方法、创新业务流动性风险管理、流动性风险监测、应急处置和报告等相关流程。风险管理部作为公司流动性风险管理的职能部门,对流动性风险进行独立识别、评估、计量和监控,拟定公司流动性风险限额要求,开展流动性压力测试,对创新业务进行流动性风险评估。计划财务部配合实施优质流动性资产管理,建立应急计划。公司建立有流动性风险动态监控系统,对指标进行实时监控。

### (5) 合规与法律风险

公司建立董事会—经营管理层—合规总监—合规管理部—各部门、各分支机构、各子公司的五级合规管理组织体系,在各自职责范围内履行合规管理职责。在合规咨询与审核、合规检查与监测、反洗钱、隔离墙管理、风险处置及监管配合等方面开展工作,对公司经营管理中的相关风险进行识别、评估和监控,有效防范合规风险。

2017 年,公司在原有净资本、流动性、业务线条监控系统的基础上,完成了平台 4.0 系统的上线数据调试工作,重点立项建设公司市场、信用、操作等风险类型的管理模块系统,以全面实现公司对各业务条线、各个部门、分支机构及子公司的业务监控;实现对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等各风险类型的计量分析和限额管理;做到同一业务、同一客户相关风险信息的集中管理;为压力测试、资本规划、限额监控等方面提供支持。公司每年均聘请会计师事务所作为第三方机构,对公司内部控制机制的建立和执行情况进行审核,对公司的风险因素及风险防范措施的有效性和健全性进行分析和评估,推动公司持续完善内部控制机制。

## 3、控制活动



### (1) 经纪业务

公司建立健全了经纪业务组织架构。公司对分支机构实行总部—分公司—营业部的管理模式，营业部已全部纳入分公司管理，以分公司为依托，整合地区资源优势，因地制宜，强化对证券营业部的管理，有利于促进降本增效，推动经纪业务创新转型。公司经纪业务管理总部、营销管理中心及合规、风控、稽核部门定期或不定期对分支机构运营情况实施检查。分支机构岗位设置方面，公司建立并严格执行岗位制衡机制，对经纪业务前、中、后台业务和岗位进行有效分离，对不相容岗位实行双人双责和相互制约的监督机制，并通过风控岗位监控、层级审批、总部集中审核等手段强化对单人单岗业务的管理；公司建立了业务权限审批制度，对业务权限采取角色化管理、分级管理、对口管理、管理留痕等管理措施；营业部财务经理和电脑人员由总部直接委派管理。报告期内，根据中国证监会发布的《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》的要求，公司所有分支机构均设置风控合规专员，配合业务主管部门和合规风控部门，对所在单位的内部控制进行全面把控。

公司建立健全了经纪业务管理制度体系。报告期内，公司根据适当性管理新规要求，对公司柜台开户业务、网上开户业务、见证开户业务、分级基金、港股通、股票期权、ETF 基金、创业板、风险警示与退市整理股票、全国股转系统、开放式基金代销等制度进行了修订。公司经纪业务部门和分支机构均能按照公司现有制度和业务流程开展各项业务。

公司积极落实监管部门关于股票期权适当性管理相关要求，2017 年，公司修订了《股票期权投资者适当性管理细则（试行）》与《股票期权经纪业务操作规程（试行）》，对股票期权业务开户资质条件与办理流程作了重新规定。此外，公司组织分支机构开展了两年一次的股票期权业务后续评估，重点对投资者身份证有效期、风险承受能力级别、开户时的资质等条件进行了重新评估。通过后续评估，公司股票期权业务运营管理工作得以进一步梳理和强化。港股通业务建立了完善的制度体系和业务流程。报告期内，港股通业务稳步有序开展。

公司建立了证券经纪人管理机制。根据制订的《证券经纪人管理指引》、《证券经纪人客户异常交易监控指引》、《证券经纪人客户回访规定》、《证券经纪人客户投诉和纠纷处理规定》等 12 项管理制度，规范开展证券经纪人各项管理工作。公司从人员招录到执业行为管理均规定了严格的操作流程，最大程度地控制各类风险。此外，公司风险管理部等部门通过监控系统对证券经纪人所招揽客户的交易情况进行监控，营销管理中心和相关分支机构对证券经纪人客户进行回访，确保及时发现和有效控制证券经纪人的违规风险；合规管理部门根据相关监管要求以及公司制度规定对证券经纪人的管理工作、证券经纪人的执业行为进行合规检查，监督相关监管规定和公司制度的贯彻和落实，防范违规风险；稽核部对公司相关部门及分支机构的证券经纪人管理情况进行稽核，实施事后监控。公司一整套的科学管理，为证券经纪人制度的实施提供了有力保障。

公司建立了经纪业务内控平台，风险管理部门、分支机构等通过技术系统对客户证券交易、资金划转、资金冻结解冻等业务进行实时监控，并积极配合交易所的市场监察工作。监



控系统对公司经纪业务客户每日的交易活动进行实时数据采集和展现,对客户资产安全情况进行监控,发现异常的资金流转或证券转移、异常交易及违规行为等情况时,及时进行调查和问询,必要时要求当事人作出书面承诺或说明。

公司建立健全了客户管理和服务工作机制。公司积极开展投资者教育和客户适当性管理工作,将投资者教育工作贯穿于业务的全过程,做好日常投资者教育工作的基础上,开展各项主题宣传活动。报告期内,公司组织分支机构适当性管理定期自查,每季度一次。同时,根据监管部门的通知要求及市场监管形势,公司组织了期货 IB、分级基金、股票期权等多次业务专项自查。通过多次专项自查,对分支机构重点业务适当性管理工作执行落实情况进行了查验摸底,对发现的问题及时督导分支机构进行了整改,帮助分支机构抓住了日常适当性管理工作的重点。

公司完善了客户投诉处理制度,建立了客户投诉、纠纷处理机制。公司及分支机构向客户公布客服电话、电子邮件等信息,客户可通过多种途径进行投诉。针对不同的投诉,公司责成有关部门、分支机构及时予以妥善处理。

此外,公司不断加强交易佣金管理。要求分支机构按规定测算并合理制订交易佣金标准;对持股比例超过上市公司股份总数 5%的账户实施重点监控,积极配合交易所的市场监察工作;妥善保管和使用客户档案,公司发布实施了《经纪业务客户电子档案管理办法》,对客户电子档案的分类和范围、扫描上传、审核统计以及使用等事项作出明确规定,稳步推进存量客户档案电子化工作,加强档案管理。

## (2) 投资银行业务

公司建立健全了投资银行管理制度体系。公司投资银行业务制度覆盖了项目承揽、立项、辅导、尽职调查、材料制作、市场推广、持续督导以及保荐档案管理等业务环节。报告期内,为适应最新监管趋势的要求,公司制定及修订了《南京证券股份有限公司投资银行业务内部控制基本制度》、《南京证券股份有限公司固定收益产品发行审核委员会议事规则》、《南京证券股份有限公司投资银行业务投资者适当性管理办法(试行)》、《南京证券股份有限公司固定收益总部债券簿记建档发行业务管理办法》、《南京证券股份有限公司关于分公司从事全国中小企业股份转让系统业务实施办法(试行)》等制度,对相关环节的要求和流程进行了完善。

公司建立了投行业务风险控制体系。公司建立了包括公司风险控制委员会、内核小组、投资银行运营内控部、风险管理部及合规管理部等在内的投行业务风险控制组织体系。公司风险控制委员会对投行业务的重大风险进行监督、控制和处置。内核小组对项目尽职调查情况进行问核,督促项目人员切实履行尽职调查职责,并通过召开会议研究、组织对投行项目核查等途径揭示和控制风险;投资银行运营内控部对项目全过程实施持续监督和质量控制,协助项目组处理项目实施过程中的疑难事项,负责召集评审立项会议和内核会议,审核项目各个阶段的工作底稿、申请文件、反馈意见回复等各项文件,并落实内核小组意见;风险管





理部门在正式开展业务前按规定对风险控制指标进行敏感性分析和压力测试;合规管理部门指派专人对投行项目合同等文件进行审查,参加内核会议及项目现场核查,对项目运作情况进行监督。风险控制工作覆盖了投资银行业务的主要业务环节,通过对项目实施全程管理,有效防范业务风险。

公司采取有效措施,严格落实信息隔离制度。投行业务部门在业务、物理、人员隔离方面严格执行公司信息隔离相关方制度要求,并与其它存在利益冲突的业务部门之间保持相对封闭和独立,严格控制内幕信息的知情范围,防范内幕信息的传递。及时向公司合规管理部报备员工信息;严格遵守时点要求在信息隔离墙系统添加限制名单和观察名单,并履行跨墙审批流程;组织、督促内幕信息知情人填写《上市公司内幕情况登记表》,告知保密义务和责任,对内幕信息知情人进行统一管理。

公司建设并上线了“大投行业务管理系统”,设置项目管理、人员管理、合规管理、财务与合同管理、综合管理等多个功能模块,以实现部门日常管理的线上化和留痕化,减少各项管理流程中的操作风险。报告期内,公司对“大投行业务管理系统”中的财务、合同、合规、工作底稿管理等模块功能进行了改进和完善,进一步提升部门内控管理实效。

### (3) 自营业务

公司建立了相对集中、权责统一的自营业务管理组织体系。公司建立了包括董事会、证券投资决策委员会及自营业务部门在内的三级决策管理体制。董事会确定自营规模、风险限额等指标,并授权总裁室负责自营业务的投资运作管理。证券投资决策委员会负责制订自营业务投资策略,确定证券投资持仓比例及资产配置方案,评审自营业务重大项目等。投资管理总部在投资决策委员会规定的仓位配置范围内进行投资操作。投资管理总部下设做市业务部,做市业务在董事会授权的投资规模范围内,确定投资限额及做市品种。公司金融衍生品部根据公司董事会及投决会确定的业务总体策略,具体负责金融衍生品业务开展,并负责业务的前端风险控制工作,制定具体操作方案,在操作过程中进行必要的策略优化,在权限范围内向交易员发出指令,交易员执行指令。

公司建立了自营业务管理和风险控制制度体系。公司在自营业务管理体系、投资决策、业务操作规范、风险控制等方面建立了完善的制度体系。2017年度,公司根据监管要求和业务开展需求对自营业务管理制度进行全面梳理,制定和修订《金融衍生品策略投资风险管理体系指引》、《金融衍生品部期权业务风险管理办法》、《全国中小企业股份转让系统做市业务管理办法》、《全国中小企业股份转让系统做市业务交易行为管理办法》等制度。公司投资管理部门严格执行信息隔离制度。自营业务部门内部的投资组合制订、交易指令执行、资金核算、合规风控等岗位相互分离,由不同人员负责并相互制衡;公司在投资业务与经纪、资产管理、投资银行、研究咨询及信用交易等其他业务之间建立隔离机制,防范利益冲突。公司建立了自营账户审批和稽核机制,严禁变相自营、账外自营及出借账户;自营业务使用自有资金及依法筹集的资金,所需资金必须严格履行审批手续后方可调度;自营部门财务人员实

行委派制，由自营部门和财务部门双重管理，加强财务管理；建立健全了自营业务风险敞口和止损情况的联动分析与监控机制，建立了自营业务监控系统，风险管理部门通过技术系统对自营业务操作进行监控，发现异常及时预警。证券投资及资产管理风险控制委员会对业务风险进行研究并及时召开会议确定应对策略；风险管理部门在确定自营投资规模时，进行风险评估和压力测试，在业务开展过程中，高度关注业务风险，及时向自营部门提交风险评估报告或风险揭示书，指导风险防范工作。合规管理部门根据相关监管要求以及公司制度规定对自营业务进行合规检查，监督相关监管规定和公司制度的贯彻和落实，防范违规风险；稽核部通过不定期稽核实施事后监控。

公司建立健全自营业务风险管控措施。通过事前风险评估、事中风险监测、事后风险处置等措施对自营业务开展中的市场风险、流动性风险、信用风险和操作风险进行管控。市场风险方面，公司风险管理部和部门风控合规专员运用压力测试、测算模型等方法进行事前风险评估，以及事中风险监测，当单只品种证券投资出现亏损达到一定幅度时，风控合规专员或风险管理部向投资经理发出止损预警，并报部门负责人或投资决策委员会。流动性风险方面，公司对自营投资单个投资品种或单只证券的投资额度均规定了严格的授权层级和比例限制；对于低流动性投资品种（债券、银行理财等）采取规避或低持仓、持有到期策略。信用风险方面，公司制定并执行证券池制度，明确自营部门只能交易证券池范围的证券，同时对债券发行人和债券本身的信用评级、担保情况、企业性质和基本面等进行评估，防控信用风险。操作风险方面，公司要求自营业务部门的投资指令和交易指令严格分开，研究、交易、估值、清算等岗位严格分开，交易系统操作权限严格管理，以防控风险事项的发生。

#### （4）资产管理业务

公司建立健全了资产管理业务风险控制体系。公司建立了包括资产管理业务投资决策委员会，风险管理部、合规管理部及稽核部等公司内控部门在内的、较为完善的资产管理业务合规、风险管理体系。资产管理总部风控合规专员在公司合规管理部、风险管理部的指导下开展日常管理工作。公司资产管理总部作为独立的资产管理业务部门统一管理客户资产管理业务，资产管理业务与自营业务、证券经纪业务及投资银行等业务在账户、人员、信息、办公场所、会计核算等方面完全隔离，且严格禁止资管产品账户与公司自营账户之间发生交易，确保客户资产与公司资产相分离。资产管理总部内设市场推广部、集合投资部、固定收益投资部、研究策划部、中央交易室、运营管理部等二级部门，分别负责客户开发与客户服务、集合产品投资、定向产品投资、宏观分析与行业研究、交易指令执行、产品估值与清算等工作，保证资产管理前、中、后台各业务环节相互分离，各岗位职责明确。对于直接参与投资指令执行、交易、资金运用等风险较为集中的岗位实行双人负责制；对于单人、单岗处理的业务，由该岗位的上级主管履行监督职责，并由部门风控合规专员监控其业务操作。

公司建立了完善的资产管理业务管理制度体系。报告期内，公司建立了覆盖资产管理业务的产品设计、推广、研究、投资、交易、登记、清算、会计核算、信息披露、客户服务等





环节的制度体系。资产管理业务的相关业务流程进一步明确和规范。部门负责人、资产管理投资决策委员会秘书、投资主办人、研究岗、信息披露和客户服务岗、集合和定向业务交易岗、风控合规专员、渠道拓展岗、产品设计岗、估值岗、清算岗、系统管理岗均能在制度流程规定的范围内履行职责。公司对不同资产管理产品单独设置账户、独立核算、分账管理，客户资金均由银行托管；合规管理部对资产管理的各个业务环节进行合规指导，发表合规意见，并对资产管理总部从业人员的执业行为合规性进行检查和监控，防范利益输送、内幕交易等违法违规行为；风险管理部对资产管理业务各产品的风险控制情况进行实时监测，协助资产管理总部识别和控制业务运作过程中面临的各项风险；公司稽核部对资产管理业务进行定期或不定期的稽核检查，及时将内部审计结果反馈至公司董事会及资产管理业务投资决策委员会；通过共同监督资产管理业务的规范运作，确保符合监管规定和合同要求，有效保护了投资者利益。

#### （5）信用交易业务

公司构建了完善的信用交易业务管理组织体系。公司建立了包括董事会、信用交易业务决策委员会、业务执行部门和业务监督部门及分支机构四个层级在内的信用交易业务决策授权体系。董事会负责审批信用交易业务总规模；信用交易业务决策委员会负责制订业务操作流程，选择可从事该业务的营业部，确定相关业务标准；信用交易管理部负责信用交易业务的具体管理和运作，确定对具体客户的授信额度，对营业部的业务操作进行审批、复核和监督；业务执行部门包括公司各职能部门，负责根据各自的业务分工和职责开展工作；营业部在公司总部的集中监控下，按照制度规定，具体负责客户征信、签约、开户、交易执行、风险监控等业务操作。

公司建立了信用交易业务管理制度体系。公司制订了《融资融券业务管理办法》、《约定购回式证券交易业务管理办法》、《股票质押式回购交易业务管理办法》等多项制度，对信用交易业务的管理架构以及业务流程、结算流程、会计核算、风险控制、客户服务及信息披露等各业务环节、操作流程予以明确和规范。报告期内，公司修订了《南京证券股份有限公司客户信用账户管理办法》、《南京证券股份有限公司融资融券业务客户信用评级与授信管理办法》、《南京证券股份有限公司融资融券业务合同管理办法》、《南京证券股份有限公司融资融券业务操作指引》《南京证券股份有限公司股票质押式回购交易业务客户资质管理办法（试行）》、《南京证券股份有限公司股票质押式回购交易业务交易操作指引（试行）》等制度，制定了《南京证券股份有限公司信用交易业务投资者适当性管理细则》，进一步强化客户资质管理和风险承受能力测评与匹配的相关标准和流程，从准入环节严控业务风险。

公司加强了信用交易业务的风险控制。公司在信用交易业务与资产管理、自营以及投资银行等业务之间建立隔离机制，防范利益冲突；对信用交易业务实行由总部集中管理的业务模式，实行集中交易、集中清算，客户信用资金账户由存管银行第三方存管；实施严格的投资者适当性管理制度以及征信审批程序，营业部在对客户进行征信调查、风险揭示等必要程



序，并经审核确定其符合标准后，方为客户办理开户手续；建立了信用交易业务交易系统，设置有关监控指标和阈值，对客户信用交易进行监控和预警；风险管理部门通过独立的信用交易业务风险监控系统地信用交易业务各项指标及客户风险状况、客户异常交易等进行实时监控，发现异常及时进行风险预警，确保业务风险可控。

#### （6）固定收益业务

公司固定收益业务包括债券销售业务、债券交易业务、债券投资业务、财富中心业务和债权融资业务，建立了包括董事会、固定收益投资决策委员会、自营业务部门三级投资决策体制。年度固定收益投资规模由董事会决策，固定收益投资决策委员会主要负责制订投资策略、确定债券投资持仓比例及资产配置方案以及对重大债券投资项目实施进行评审，固定收益总部在公司授权范围内开展业务。债券交易及投资业务在决策审批上实行“交易复核-交易审核-交易审批”的“三步走”原则。交易员在系统中提请发起交易后，由指定专人对交易指令进行复核，完成后由风控合规专员予以审核并评估风险，通过后由投资决策人员进行审批后方可执行。财富中心主要负责机构客户金融产品投资的投资咨询业务，为机构客户提供投资顾问服务，对客户进行风险承受能力判断、风险揭示、签订投顾协议后提供投顾建议，并定期对客户进行回访。债权融资业务按制度对业务流程进行了细化，对发行承销项目实施合理的项目进度跟踪、风险节点控制、方案设计管理、材料制作质量控制以及存续期后续管理等。

公司加强了固定收益业务的制度体系。报告期内，公司固定收益业务密切跟踪行业监管趋势，制定和修订制度 15 项。债券交易方面，修订并完善交易和结算、参团和分销、头寸管理、应急交易、转托管业务、大宗交易和固定收益平台交易等方面的办理流程和要求。债券销售与承销业务方面，修订并完善了簿记建档发行业务、债券投资者适当性管理、固定收益产品发行审核委员会议事规则等方面制度。内控管理方面，修订并完善了部门内部控制、从业人员管理、信息隔离墙、档案管理等方面的管理要求。通过对制度的全面梳理、修订和补充，强化了制度建设，形成了较为完善的固定收益业务管理制度体系。

公司加强了固定收益自营业务的风险控制。公司固定收益总部在公司授权范围内开展业务，对超过授权范围业务，按照公司审批程序审核后实施。公司固定收益总部与其他业务部门之间保持绝对的物理隔离，跨部门、跨业务条线的业务决策机构建立并执行严格的回避制度，严格执行跨墙管理制度，以防可能产生的利益冲突和业务风险。

#### （7）场外市场业务

公司建立完善了场外市场业务管理制度体系和业务流程。公司根据报价系统的业务规则和监管部门的规章制度对公司的业务流程进行了整理和优化，特别是对产品的发行和到期兑付流程进行了标准化规范，并加以细化，对产品发行和到期兑付过程中的每个操作流程的时间点做了明确规定，有效防范了业务风险，提高了工作效率和合规有效性。

公司加强了场外市场业务的风险控制。一方面，加强场外市场产品质量的风险控制。对



于外部引进的产品,公司相关部门会先进行产品供应商的资质审查。供应商通过审核后,公司将召开代销金融产品业务决策委员会会议,以保证产品的合规、风险可控、优质,最终方可发行;对于公司自行创设的产品,由创设部门根据市场情况、公司的实际情况,在风险可控的原则下设计、创设产品和风险等级自评,研究所就创设产品进行尽职调查、风险等级初评,风险管理部对风险等级进行复评,由相关条线的业务管理、决策委员会审议,以确保产品的质量和风险可控;另一方面,加强了场外市场服务的风险控制。对于申请参与场外市场的客户,分支机构业务人员会针对客户开展投资者教育和风险揭示等工作,在为客户介绍场外市场相关基础知识的同时,为客户揭示场外市场存在的特有风险,与客户签订场外市场开户的相关协议,进行风险揭示,并明确双方的权力和义务,最后为客户开立场外市场产品账户。在客户购买产品时,应确认客户的风险承受能力与产品的风险等级相对应。

公司加强场外业务监管报备的管理。公司明确场外业务管理总部作为场外业务信息报备的归口管理部门,负责对公司所开展的各类场外业务进行梳理、分类,并组织、督促相关部门及时进行备案与报告工作。报告期内,公司共完成 12 次定期报告的申报工作,进一步完善与落实持续备案与报告的工作机制和工作要求,为公司场外市场业务内部控制的有效性奠定了基础。

#### (8) 代销金融产品业务

公司制定了代销金融产品制度体系。报告期内严格按照《分支机构金融产品销售业务决策委员会议事规则(试行)》《代销金融产品业务委托人资格审核办法》及《代销金融产品业务客户投诉处理制度》等制度开展业务。为全面落实《证券期货投资者适当性管理办法》的相关要求,本年度,公司对客户适当性管理、客户回访与投诉等系列制度进行修订与补充,发布了《南京证券股份有限公司投资者适当性管理办法(试行)》、《南京证券股份有限公司双录操作指引(试行)》、《南京证券股份有限公司客户回访管理办法(试行)》等制度,明确了代销金融产品业务开展过程中,全面、持续了解客户,综合评估投资者风险承受能力,对投资者进行分类管理,对金融产品或服务进行风险评估的具体要求及流程;建立投资者与金融产品或服务的匹配机制;健全客户回访检查、评估与销售隔离、培训考核、执业规范、监督问责等内控机制。

公司加强了代销金融产品业务的合规风险防范。公司加强信息披露管理,落实客户适当性管理及客户回访机制,适时向投资人披露产品运行状况及风险匹配情况;严格执行客户投诉处理工作。公司设立多种受理客户投诉的渠道,在官方网站、营业场所显著位置公示客户投诉电话、传真、电子信箱,在营销管理总部客户部门设立专门投诉人工坐席,并建立了客户投诉书面及电子档案,按规定保存期限进行保管。

#### (9) 期货 IB 业务

公司建立了期货 IB 业务管理组织体系。公司指定经纪业务管理总部专门负责期货 IB 业务的管理和协调工作。相关营业部按照规定建立了分工明确的期货 IB 业务管理架构。营



业部负责人、期货 IB 业务人员及电脑人员按照各自职责共同负责期货 IB 业务开展中的有关工作。营业部负责人全面负责营业部期货 IB 业务的管理工作, 营业部指派两名期货 IB 业务人员, 负责期货 IB 业务办理、审核及相互复核等工作, 电脑人员负责营业部期货 IB 业务相关软硬件设备的架设、调试与维护等工作。

公司加强了期货 IB 业务合规风险控制。报告期内, 公司有 54 家营业部获准开展 IB 业务。公司各证券营业部设置相对独立的 IB 业务办理区域, 与证券业务场所相对分离, 并配备必要的设施和技术系统, 按规定公示业务信息; 对开户资料进行严格审查, 加强风险揭示和投资者教育工作, 依法对申请开立股指期货账户的客户进行培训、知识测试和综合评估, 依法为客户提供协助开户等相关服务; 公司合规管理部门对期货 IB 业务开展情况进行合规检查, 对于发现的问题予以督促改进。

#### (10) 投资咨询及研究报告业务

公司建立健全了研究咨询业务管理制度体系。公司在原有制度体系基础上, 不断健全完善业务管理制度体系。2017 年度, 公司继续健全完善业务管理制度体系, 修订了《南京证券股份有限公司证券分析师管理办法》、《南京证券股份有限公司证券投资咨询业务与媒体合作管理办法》和《南京证券股份有限公司证券投资顾问业务适当性管理细则(试行)》, 进一步强化研究报告发布的合规与质量审核, 建立健全投资咨询业务与媒体合作的内部管理机制, 明确投资咨询业务客户适当性管理的流程与要求。

公司加强了研究咨询业务的风险控制。公司在研究所与自营、资产管理和投资银行等其他业务之间建立信息隔离机制, 建立了观察清单和隔离清单制度, 防范利益输送; 加强对从业人员执业资格和执业行为的管理和监督, 发布研究报告的研究人员必须具备必要的从业资格; 公司按照规定对重点研究报告进行审核, 并及时将研究报告所涉及证券录入信息隔离系统, 根据情况对资产管理及自营等部门在规定时间内采取限制交易等措施, 防范合规风险。

公司严格落实投资顾问业务的适当性管理要求。公司要求向客户提供证券投资顾问产品或服务, 应当充分了解客户基本信息, 对客户进行风险承受能力测评, 并按测评结果分类管理。对所提供的投资顾问产品或服务, 应当评估风险等级, 在提供服务过程中严格执行风险承受能力相匹配的原则。完善投资顾问系统中适当性管理模块, 设置前置风险评估及匹配环节, 满足客户适当性管理需要。

公司加强与媒体合作的审查与管理。公司研究所指定专人对证券分析师及证券投资顾问与公众媒体合作进行事前审查, 审查内容应涵盖人员资质情况、信息来源合法合规、风险提示是否到位、授权转载或转发的合规性等, 并安排专人对节目内容进行事前审查、事后检查; 合规管理部负责审查投资咨询业务与公众媒体合作中利益冲突防范机制和信息隔离墙制度执行情况, 出具合规意见; 研究所及时将相关情况在规定时间内向监管机构报备。

#### (11) 创新业务

公司高度重视创新业务的风险控制工作。在申请开展创新业务前, 公司进行充分的前期





市场调研，对创新业务的合规性、可行性以及相关风险因素进行全面分析论证；董事会、管理层按监管要求和公司制度规定依法作出有关决策；在业务开展前，公司制订相关制度流程和风险控制措施，并报合规总监或合规管理部门进行合规审查；风险管理部门按照监管规定开展敏感性分析和压力测试等工作，协助董事会和经营管理层作出决策。报告期内，公司积极申报和开展私募基金综合服务业务、资产托管业务和 PB 业务。公司根据新业务要求，及时拟定相关业务方案，制订业务制度、流程及协议文本，并组织相关部门开展技术系统测试。2017 年，公司对《主经纪商业务投资管理系统管理办法（试行）》进行了修订，加强 PB 系统使用流程管理，规范 PB 系统相关操作人员申请、变更、注销业务权限的办理流程，确保 PB 系统的高效运行和主经纪商业务的顺利开展。此外，公司还加强对 PPP 业务和海外发行债券业务的研究。

#### （12）结算存管业务

公司建立完善了结算存管制度体系，明确结算存管中有关交易清算、资金汇划交收、资金存放、资金余额核对、逐日盯市、风险管理、日常监控等各项业务环节规定，加强了对客户交易结算资金的管理，确保了客户交易结算资金的安全性和流动性。

公司加强了结算存管业务的风险控制。资金交收方面，能够统筹安排资金，合理调配，划付工作经双人操作，完成申请、授权、审批、发送流程。会计核算完整及时、准确，做到日清月结；结算存管中心负责公司所有业务的清算、资金交收、核算、协助司法执行等各项业务，重要岗位配置 A、B 角，业务开展严格遵守各项制度，符合业务流程规范。所有人员操作流程均有留痕。操作人员权限分配合理，工作职责明确，工作流程清晰；会计凭证资料齐全、全部装订成册，存档保管；工作日志能够做到按系统、按业务逐项记录，工作日志等业务资料保存完整。公司能够有效防范交易清算、交收、核算风险，保证各项业务合规开展。

#### （13）会计系统

公司建立了财务会计控制体系。依据会计法、会计准则及相关财经制度的要求，公司在财务管理、税务管理、会计核算、会计信息系统管理、会计信息披露、资金管理等方面建立了相应的规章制度。严格按照《企业内部控制基本规范》、《企业内部控制应用指引》等规定的要求，设置工作岗位，规范相应岗位职责，对业务流程进行梳理、优化和完善，从而加强与财务报告相关的内部控制。

公司建立了财务管理内部控制体系。公司制订了《财务预算管理办法（试行）》，推行全面预算管理，对未来经营环境进行分析预测，以价值形式确定预算期内经营目标，并分解下达到公司内部各经济单位。公司明确了《费用管理暂行办法》等财务管理制度，对总部及各分支机构的预算执行和费用列支管理流程进行规范，确保对公司经营事项进行全过程控制。

公司制订了《总部增值税管理制度》、《分支机构增值税管理制度》、《增值税会计核算办法》等税务管理制度，明确了总分支机构增值税进项发票管理、销项开票管理、纳税申报管理等事项管理流程及职责，防范增值税涉税风险，规范公司增值税税务管理，保证公司依法



合规履行增值税纳税义务。

公司建立了会计核算和会计信息系统内部控制体系。公司制定了《会计核算制度》、《固定资产管理制度》等基本会计核算制度；明确了金融工具及长期股权投资的分类、确认、计量标准，可供出售金融资产减值认定标准，融资融券业务坏账准备计提比例等重大会计政策或会计估计。同时设置科学的财务会计组织架构，配备合格财务会计专业人员，规范会计核算操作流程，确保各个财务岗位分工合理、职责明确，确保各个业务遵循健全、完整的审批授权程序。公司制订了《财务信息系统管理办法》，设立专人专岗负责财务信息系统的日常管理与维护，从技术手段上，确保了会计信息审核制度等一系列内部监督检查流程、制度的有效运行。

公司建立了财务信息披露内部控制体系。公司明确了财务报告编制管理规范，建立了完善的财务报告编制流程，以保证公司对外披露的财务信息内容完整、数字准确、披露及时。

公司建立了资金管理内部控制体系。公司在自有资金管理、自有资金头寸管理、债券募集资金管理、债务融资管理、同业拆借业务管理、网上银行划款管理、债券募集资金专户管理等方面建立了相应的规章制度，在客户资金与自有资金严格分离的基础上，对公司自有资金实行集中管理、分级控制，根据流动性风险监管要求，结合业务资金需求，统筹资金来源、扩大融资渠道，实施流动性管理。具体措施包括：一是对自有资金实行集中、统筹管理。由计划财务部负责在公司授权范围内对自有资金统一调度，各业务部门在风险限额内，依据业务资金授权与审批使用资金。二是制订年度资金预算、融资计划，提前筹划融资规模、融资方式。公司对日、周、月大额资金需求实行预报，在考虑业务资金实际使用的基础上，充分预计未来现金流入、流出量以及流动性风险监管指标压力，结合年度融资计划确定未来 1-3 个月具体融资方案，确保日常流动性充足，满足支付需求。三是加强负债管理，将融资渠道管理、融资对手关系维护作为负债管理的重要环节，不断扩大授信范围、规模，提高融资来源的多元化、稳定程度，降低负债成本，满足融资需要。四是强化流动性管理，成立了流动性风险应急小组，对流动性风险事件明确了应急处置原则、程序、措施，并由风险管理部组织应急计划制定、演练、评估，最大程度减少流动性风险事件造成的危害。报告期内，公司对债券募集资金专户、募集资金管理进行规范，对募集资金的专户存储、使用、变更、监督等工作进行明确，以符合监管要求。

公司监事会、内部稽查部门以及外部审计机构等依据《公司章程》和相关规定对公司财务进行有效地检查监督，并对公司财务报告发表专业的审计意见。公司财务报告正式出具后，将按规定程序报送监管部门，并及时在指定媒体上披露。

#### （14）信息系统

公司建立了完善的信息系统组织体系，从组织架构、制度、管理等方面，采取各种措施加强信息系统管理。公司设立信息技术总部，行使信息技术支持和管理等职能，负责公司信息系统的规划建设、开发维护、日常管理与技术支持等工作。分支机构设置专职电脑部经理，





负责分支机构信息系统日常维护,在技术上服从信息技术总部管理,从而加强总部对分支机构技术工作的管理。公司遵循安全、实用、可操作性原则,制定了信息系统的管理规章、操作流程、岗位手册和风险控制等各项制度并根据实际情况不断修订,从 IT 整体治理、人员管理、设备管理、软件管理、数据管理、机房安全、操作安全、病毒防范、防黑客攻击、事故防范与应急处理等各个方面强化对信息技术系统的规范化管理。

公司对系统建设持续投入。2017 年 4 月,公司新数据中心正式启用并完成了新旧数据中心割接迁移工作,为公司未来信息系统的发展建设提供了坚实的基础。公司不断完善监控系统,对业务系统风险进行全面监控、管理,对业务操作和交易中的风险进行实时监控。公司重视适当性管理工作,针对适当性管理工作的要求,持续对包括集中交易、股票期权、融资融券、网上开户、网上交易、手机交易、金罗盘等 21 套系统进行改造扩容,新建适当性管理系统、双录系统、统一电子协议等 3 套系统。根据各业务条线的发展需求,公司不断完善升级各项业务信息系统。

公司重视信息安全工作。公司不断加大信息安全投入,推进网络及信息系统安全服务、防病毒、扫描、渗透、测评、加固等工作。严格按照证监会和公安部颁布的信息系统安全等级保护管理制度执行,每年按照等保要求,对信息系统评估定级,对等保三级以上的系统进行第三方测评,根据测评结果及时进行安全加固与整改;做好信息系统定期安全扫描与加固,及时发现系统薄弱环节并整改;积极响应突发信息安全事件,防范病毒入侵;公司通过外聘第三方专业安全服务的方式,不断完善公司安全体系建设。公司重视备份体系的建设与完善,建立了完善的应急切换与保障体系,制定应急预案,定期做好应急演练工作,验证应急预案的合理性,并提高技术人员应急切换保障能力。

公司实施严格的系统权限管理、人员管理与数据管理。系统设计、软件开发等技术人员与实际业务操作人员相互独立,禁止同一人同时掌管操作系统口令和数据库管理系统口令。所有应用系统操作柜员均采用实名制并按最小化原则赋予权限,所有赋权过程必需经复核才能生效。公司做好人员离岗管理工作,人员离岗必须办理离岗手续,明确其离岗后的保密义务,退还全部技术资料,并立即在相关应用系统中停用其柜员账号。公司对业务数据实施严格的安全保密管理,建立信息数据的即时保存和备份制度,并坚持信息数据的定期查验制度;公司重视信息系统运维人员技能和合规意识提升,定期组织技术人员学习培训,定期开展灾备切换、系统应急处理等各项模拟演练操作,提高技术人员业务熟练性和业务技能。

#### (15) 子公司管理

公司重视对子公司的管控,通过对主要负责人及高管的任职审批、重大事项的报告、董事的委派等措施,以确保子公司的规范经营。公司专门制定下发了《子公司管理办法(试行)》、《子公司合规与风险管理办法(试行)》等制度,从治理结构、人事管理、经营管理、财务管理、合规风控、事项报告等六个方面,进一步全面加强了对子公司的管理。目前,公司还通过建立合规风控联席会议机制,以加强相互间合规风控信息的沟通与交流;以不定期现场或



非现场合规风控检查方式,掌握子公司业务开展的合规风控情况;通过建立日常信息报送和重大事项报告机制,及时掌握子公司经营情况。

#### (16) 反洗钱

公司建立了反洗钱制度体系。报告期内,公司结合最新的监管规定与结合证券行业特点,进一步梳理现行反洗钱内控制度与工作流程,修订了《反洗钱工作管理办法》、《大额交易及可疑交易报告管理办法》、《洗钱风险自评估管理办法》,要求将可疑交易监测工作贯穿于业务办理的各个环节。同时,公司研究交易监测标准与大额交易和可疑交易监测系统,完善反洗钱监测体系,全面升级反洗钱大额交易和可疑交易监测系统。

公司建立了专门的反洗钱信息系统。反洗钱系统大额可疑交易模块根据设定的监控指标和阈值对大额交易和异常交易进行预警。可疑交易预警经过分支机构、合规管理部及经纪业务管理总部三级复核,确保及时发现可疑交易和大额交易,并按规定向监管部门报送有关报告。公司秉承全面性、分级管理、适时性、同一性与保密原则开展反洗钱客户风险等级划分,采取定性分析与定量分析相结合的方式,计量和评估客户风险等级。公司利用反洗钱客户风险等级划分系统辅助完成风险等级划分的初评工作。公司客户账户管理系统自动提示反洗钱客户风险等级与黑名单等信息,实现了业务系统与反洗钱管理系统的联动。

公司切实履行反洗钱工作职责。公司指定专人负责反洗钱的日常监控及相关报告工作;相关业务开展过程中,对客户信息和客户资料严格审核,确保对客户的身分识别符合监管要求;严格按照监管部门的要求,切实做好反洗钱内部审计工作;在公司内外积极开展反洗钱宣传教育工作,通过组织专项宣传活动,派发宣传资料、接受咨询等方式,在公司员工及投资者中大力宣传反洗钱的监管要求和工作意义;指导相关业务部门与分支机构开展日常反洗钱培训。同时,将各部门、分支机构的反洗钱培训、反洗钱制度建设等纳入公司合规检查的范围,对于发现的问题,均要求提交整改报告。

#### (17) 关联交易

公司已建立完善的关联交易内部控制机制。公司已根据外部法律法规,在《公司章程》、《关联交易管理办法》、《〈关联交易管理办法〉实施细则(试行)》中对关联人、关联关系、关联交易进行了明确界定,对关联交易的决策权限和程序、表决回避制度、关联交易合同的签署和执行、关联交易的统计与信息披露进行了规范,确保关联交易价格公允,并给予充分、及时的披露。一是公司按照公司章程规定的权限,将关联交易事项提交董事会或股东大会会议审议;二是对于日常关联交易、重大关联交易等事项,按规定将其提交独立董事由其发表独立意见;三是严格执行公司章程规定的关联交易回避表决机制。公司董事会审议关联交易事项时,关联董事应当回避表决,也不得代理其他董事行使表决权。报告期内,公司相关关联交易的批准程序符合相关法律法规及公司章程规定,交易定价公允,未发生可能损害公司及中小股东利益的情况。

#### (18) 对外担保



公司严格按照外部法律法规及公司章程进行对外担保的控制和管理。为规范公司对外担保行为,公司在章程中明确规定了股东大会、董事会关于对外担保事项的决策权限,制定了《对外担保管理制度》。报告期内,公司未发生对外担保。

#### (19) 印章和合同控制

公司印章管理遵循保管、使用及审批适当分离和制衡的原则。公司制定了《印章管理办法》,对公司印章刻制、印章保管、印章使用、分公司公章及营业部公章等进行严格管理。针对营业部业务印章管理,公司专门制定实施了《营业部经纪业务印章管理办法》,对营业部业务章的刻制、使用及保管等流程作出了明确规定。

公司进一步强化对合同事务的规范管理与控制。公司严格按照《合同管理办法》,对合同订立、审批、履行、变更、保管与调阅、监督与检查各环节内容与程序进行规范与细化。根据监管规定以及业务发展的要求对格式合同、示范合同及时进行更新与扩充,同时根据公司内部管理要求对合同审批程序进行合理化调整,对合同审批材料进一步统一明确。公司持续落实合同管理各项工作制度的要求,有效防范合同法律风险。

#### 4、信息与沟通

公司建立了内部沟通、汇报及反馈机制,确保信息及时准确传递。公司内控部门、各业务及管理部门定期或不定期通过风险报告、财务报告、业务报告等形式,总结、沟通和讨论业务运营及风险状况,使公司能及时掌握各业务及分支机构经营状况。公司各项业务及管理制度中,对各层级的报告路径、层级、范围进行了明确规定,确保信息能够及时有效的传递。公司通过内部办公自动化系统、电子邮件等多种信息工作平台,传递和留存内部信息。

公司定期召开党政联席会,对公司重大经营事项进行研究决策;公司定期召开经营分析会议,通报公司经营状况和经营举措,部署工作安排;相关业务部门定期向管理层提交业务经营数据或报表,使管理层能够及时了解公司的经营状况;公司创新发展办公室每季度统计各部门重点业务完成情况,使公司管理层及时了解各部门工作的完成情况;合规总监对公司合规经营情况进行监督,定期或不定期向董事会、监管部门报告公司的合规经营情况;首席风险官负责公司的全面风险管理工作,就公司的风险控制情况定期向公司董事会和监管部门报告;稽核部门按规定向管理层报送稽核报告,使管理层及监管部门及时了解稽核所发现问题。

公司建立了客户投诉、纠纷处理机制。公司及分支机构向客户公布客服电话、电子邮件等信息,客户可通过多种途径进行投诉。针对不同的投诉,公司责成有关部门、分支机构及时予以妥善处理。

公司指定专人担任董事会秘书,负责信息披露的相关事项。公司根据《公司法》、《证券法》及中国证监会相关监管规定,按期编制年度报告、合规报告及有关监管报表等文件,依法办理信息披露、报送等相关事宜。

#### 5、内部监督



公司董事会下设合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会及审计委员会,各专门委员会定期召开会议,对公司的合规管理与风险控制情况、薪酬水平及内部审计等事项进行监督。公司监事会根据公司章程的规定履行监督职责。监事会通过召开会议审议公司年度财务报告,履行财务监督职责;监事出席公司股东大会会议,列席董事会会议,对公司重大事项的决策进行监督。

公司合规总监对合规经营情况进行监督,就公司合规情况定期向公司董事会和监管部门报告。公司设合规管理部履行合规咨询、合规审查、合规检查、合规监测、合规培训等管理职责,就合规管理过程中发现的问题或风险督促有关部门或分支机构予以整改,并定期提交报告。

公司首席风险官负责公司的全面风险管理工作,向经理层提交风险管理定期报告,反映风险识别、评估结果和应对方案,对重大风险提供专项评估报告,确保董事会、经理层及时、充分了解公司风险状况。公司设立风险管理部,由专人对经纪业务、自营业务、资产管理业务、融资融券业务、投行业务、净资本及风险控制指标等进行实时监控,做到及时发现问题,及时督导有关部门或分支机构予以整改。

稽核部门通过实施现场稽核、离任稽核等方式,对业务开展的规范情况进行检查,发现和披露业务风险并向管理层提交有关报告,督促业务部门或分支机构改进不足,确保内部控制机制的有效运转。

#### (四) 内部控制评价工作依据及内部控制缺陷认定标准

公司根据企业内部控制规范体系及评价指引的要求,结合中国证监会发布的《证券公司内部控制指引》等要求,结合公司内部控制制度和评价方法,在内部控制日常监督和专项监督的基础上,组织开展内部控制评价工作。

公司董事会根据企业内部控制规范体系对重大缺陷、重要缺陷和一般缺陷的认定要求,结合公司规模、行业特征、风险偏好和风险成熟度等因素,区分财务报告内部控制和非财务报告内部控制,研究确定了适用于本公司的内部控制缺陷具体认定标准。公司确定的内部控制缺陷认定标准如下:

重大缺陷指一个或多个控制缺陷的组合,可能导致企业严重偏离控制目标。重要缺陷指一个或多个控制缺陷的组合,其严重程度和经济后果低于重大缺陷,但仍有可能导致企业偏离控制目标。一般缺陷指除重大缺陷、重要缺陷之外的其他缺陷。

公司确定的内部控制缺陷认定标准具体如下:

##### 1. 财务报告内部控制缺陷认定标准

(1) 财务报告内部控制缺陷评价的定量标准如下:

指标名称	重大缺陷	重要缺陷	一般缺陷
财务报告内部控制缺陷定量标准	财务报告错报金额占公司净资产比值大于或等于 1%	财务报告错报金额占公司净资产比值大于或等于 5%,且小于 1%	财务报告错报金额占公司净资产比值小于 5%



(2) 财务报告内部控制缺陷评价的定性标准如下:

缺陷性质	定性标准
重大缺陷	下列迹象通常表明财务报告内部控制可能存在重大缺陷: ①董事、监事和高级管理人员舞弊; ②企业更正已公布的财务报告; ③注册会计师发现当期财务报告存在重大错报, 而内部控制在运行过程中未能发现该错报; ④企业审计委员会或内部审计机构对内部控制的监督无效。
重要缺陷	具备合理可能性导致不能及时防止或发现并纠正财务报告中虽然未达到和超过重要性水平、但仍应引起董事会和管理层重视的错报的一项内部控制缺陷单独或连同其他缺陷。
一般缺陷	财务报告控制中存在的、不构成重大缺陷和重要缺陷的其他缺陷。

2、非财务报告内部控制缺陷认定标准

(1) 非财务报告内部控制缺陷评价的定量标准如下:

指标名称	重大缺陷	重要缺陷	一般缺陷
非财务报告内部控制缺陷定量标准	直接损失占公司净资产比值大于或等于 1%	直接损失占公司净资产比值大于或等于 5%, 且小于 1%	直接损失占公司净资产比值小于 5%

(2) 非财务报告内部控制缺陷评价的定性标准如下:

指标	重大缺陷	重要缺陷	一般缺陷
营运影响	严重损伤公司核心竞争力, 严重损害公司为客户服务的能力	对内外部均造成了一定影响, 比如关键员工或客户流失	对日常营运没有影响, 或仅影响内部效率, 不直接影响对外展业
监管影响	公司被监管部门撤销相关业务许可	公司被监管部门暂停相关业务许可	除被监管部门撤销或暂停相关业务许可以外的其他监管影响
声誉影响	负面消息在全国各地流传, 引起公众关注, 引发诉讼, 对企业声誉造成重大损害	负面消息在某区域流传, 对企业声誉造成中等损害	负面消息在企业内部流传, 企业声誉没有受损, 或负面消息在当地局部流传, 对企业声誉造成轻微损害

(五) 内部控制缺陷认定及整改情况

1、财务报告内部控制缺陷认定及整改情况

根据上述财务报告内部控制缺陷的认定标准, 于内部控制评价报告基准日公司不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。

2、非财务报告内部控制缺陷认定及整改情况

根据上述非财务报告内部控制缺陷的认定标准, 于内部控制评价报告基准日公司不存在非财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。

报告期内, 公司对纳入评价范围的业务和事项均已建立了内部控制, 并得以有效执行。自内部控制评价报告基准日至内部控制评价报告发出日之间没有发生对评价结论产生实质性影响的内部控制的重大变化。

立信会计师事务所(特殊普通合伙)出具了《南京证券股份有限公司内部控制鉴证报告》(信会师报字【2018】第 ZH30003 号), 审核结论如下: 南京证券按照财政部等五部委颁发的《企业内部控制基本规范》及相关规定于 2017 年 12 月 31 日在所有重大方面保持了与财



务报表相关的有效的内部控制。

#### (四) 年度报告差错责任追究制度相关情况

公司已制定实施《年度报告信息披露重大差错责任追究制度》。报告期内，未出现因年度报告信息披露存在重大差错进行问责的事项。

#### (五) 合规管理体系建设情况，合规、稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

##### (一) 合规管理体系建设情况

公司“三会”运作规范，法人治理完善，合规管理组织架构层次分明，职责明确。公司建立了包括“董事会—经营管理层—合规总监—合规管理部—各部门、各分支机构、各子公司”在内的五级合规管理组织体系。公司董事会积极履行合规领导职责，倡导合规文化；公司董事、监事和高管人员率先垂范，确保公司合规管理健康运作；公司按规定设立合规总监，在章程和相关制度中明确规定其地位、职责及任免程序等事项；公司在相关业务部门和分支机构设立风控合规专员，负责本部门或分支机构的合规管理工作。各部门、分支机构及子公司在经营管理活动中，落实各项监管要求，执行公司合规管理制度和业务制度。合规总监全面负责组织、协调合规管理工作，为董事会、管理层履行合规管理职责提供支持、协助。合规管理部协助合规总监开展合规咨询、合规审查、合规检查、合规培训、反洗钱、信息隔离墙、员工行为监测等专项合规管理工作，全面覆盖经纪、自营、资产管理、投资银行、固定收益、信用交易等业务条线，为确保公司稳健规范发展提供支持和保障。

报告期内，为落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》，公司新制定或修订了《合规管理实施办法》、《合规管理工作细则》、《合规绩效考核办法》、《高级管理人员合规性专项考核管理办法》等一系列合规管理制度，同时，修改和制订了《信息隔离墙制度》、《防范和处置非法集资工作暂行办法》、《大额交易和可疑交易报告管理办法》及《洗钱风险自评估管理办法》等专项制度，进一步明确合规工作程序和规范，加强合规管理。

##### (二) 合规、稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

报告期内，合规部门继续加大合规检查力度，主动发现、防范和控制合规风险，在公司内部保持合规管理高压态势。合规管理部于2017年1月制定并发布《2017年度合规检查计划书》，作为本年度合规检查的指引和目标。合规总监和合规管理部通过独立检查、联合检查和委托检查等多种形式，全年共开展合规检查133次，其中合规管理部独立或联合风险管理部、稽核部等部门开展检查25次，内容涵盖经纪、自营、固定收益、资产管理、信用交易、投资银行、投资咨询等主要业务条线，以及从业人员执业行为管理和印章管理等专项检查。委托分公司开展合规检查108次，充分发挥公司各层级合规管理主体职能，组织和指导14家分公司对所辖营业部开展合规检查，大大增加了分支机构的覆盖程度。合





规管理部通过行使合规检查职能,主动梳理、发现和反馈公司各业务部门及分支机构在制度健全与执行中存在的问题和不足,并督促整改,有效地防范合规风险。

报告期内,公司共开展 65 个内部审计项目,其中对分支机构、业务部门、子公司负责人的离任经济责任审计项目 16 个,分支机构常规审计项目 45 个,并就开放式基金代销、固定收益、信用交易等业务及信息系统开展专项审计,累计向审计对象提出整改意见 200 余条。



## 第十节 财务报告

### 一、 审计报告

是否审计	是
审计意见	无保留意见
审计报告中的特别段落	无
审计报告编号	信会师报字【2018】第 ZH30010 号
审计机构名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
审计机构地址	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼
审计报告日期	2018 年 2 月 23 日
注册会计师姓名	孙晓爽、孙淑平
会计师事务所是否变更	否
会计师事务所连续服务年限	7
会计师事务所审计报酬	95 万元

## 审计报告

信会师报字[2018]第 ZH30010 号

南京证券股份有限公司全体股东：

### 一、 审计意见

我们审计了南京证券股份有限公司（以下简称南京证券）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2017 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了南京证券 2017 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2017 年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南京证券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 其他信息

南京证券管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括南京证券 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式

的鉴证结论。

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

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

#### **四、 管理层和治理层对财务报表的责任**

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

治理层负责监督南京证券的财务报告过程。

#### **五、 注册会计师对财务报表审计的责任**

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

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

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

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允



反映相关交易和事项。

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

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

立信会计师事务所  
(特殊普通合伙)

中国·上海

中国注册会计师: 孙晓爽

中国注册会计师: 孙淑平

二〇一八年二月二十三日

## 二、 财务报表

### (一) 合并资产负债表

单位: 元

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产:</b>			
货币资金	六、(一)	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93
其中: 客户存款	六、(一)	5,652,875,221.68	7,623,024,609.24
结算备付金	六、(二)	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31
其中: 客户备付金	六、(二)	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
拆出资金			
融出资金	六、(三)	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	六、(四)	1,957,691,496.37	2,203,608,567.02
衍生金融资产	六、(五)		
买入返售金融资产	六、(六)	3,489,334,761.40	3,733,511,978.64
应收款项	六、(七)	5,483,767.31	6,771,393.56
应收利息	六、(八)	173,612,883.56	175,766,718.01
存出保证金	六、(九)	326,324,109.59	390,655,953.63
应收股利			
可供出售金融资产	六、(十)	2,471,278,138.55	2,500,758,263.12
持有待售资产			
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	六、(十一)	242,574,996.31	97,581,710.02
投资性房地产			
固定资产	六、(十二)	994,816,129.84	311,626,372.53



在建工程	六、(十三)	-	648,318,365.22
无形资产	六、(十四)	30,324,614.79	33,754,351.52
开发支出			
商誉	六、(十五)	5,845,161.39	5,845,161.39
递延所得税资产	六、(十六)	42,207,068.97	56,759,228.86
其他资产	六、(十七)	53,493,570.67	39,627,969.58
<b>资产总计</b>		<b>23,501,546,945.82</b>	<b>26,858,367,957.04</b>
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款	六、(十九)	1,653,910,000.00	
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	六、(二十)		57,720,060.00
衍生金融负债	六、(五)	1,051,600.00	
卖出回购金融资产款	六、(二十一)	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12
代理买卖证券款	六、(二十二)	7,052,225,490.04	9,358,238,245.28
代理承销证券款	六、(二十三)	953,688.33	108,297.15
应付职工薪酬	六、(二十四)	161,237,337.15	209,056,639.37
应交税费	六、(二十五)	84,059,186.80	107,668,830.59
应付款项	六、(二十六)	7,033,953.89	7,401,869.37
应付利息	六、(二十七)	66,306,015.98	158,183,552.16
应付股利			
持有待售负债			
预计负债	六、(二十八)	541,766.60	13,008,420.00
长期借款			
应付债券	六、(二十九)	1,697,179,834.23	4,200,000,000.00
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
专项应付款			
递延所得税负债	六、(十六)	7,315,431.46	12,946,930.48
递延收益			
其他负债	六、(三十)	510,096,731.63	832,384,174.74
<b>负债合计</b>		<b>14,101,292,180.82</b>	<b>17,578,325,285.26</b>
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	六、(三十一)	2,473,999,503.00	2,473,999,503.00
其他权益工具			
资本公积	六、(三十二)	4,072,448,984.89	4,072,448,984.89
减：库存股			
其他综合收益	六、(三十三)	-10,367,987.31	34,231,524.41
专项储备			
盈余公积	六、(三十四)	325,621,653.93	284,765,719.16
一般风险准备	六、(三十五)	1,259,707,428.94	1,177,170,128.32
未分配利润	六、(三十六)	1,245,223,603.19	1,205,414,032.52



归属于母公司所有者权益(或股东权益)合计		9,366,633,186.64	9,248,029,892.30
少数股东权益	六、(三十七)	33,621,578.36	32,012,779.48
<b>所有者权益(或股东权益)合计</b>		<b>9,400,254,765.00</b>	<b>9,280,042,671.78</b>
<b>负债和所有者权益(或股东权益)总计</b>		<b>23,501,546,945.82</b>	<b>26,858,367,957.04</b>

法定代表人：步国旬 主管会计工作负责人：夏宏建 会计机构负责人：刘宁

## (二) 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	期末余额	期初余额
<b>资产：</b>			
货币资金	十六、(一)	5,699,497,247.63	8,205,012,195.04
其中：客户存款	十六、(一)	5,196,965,163.15	7,074,541,421.68
结算备付金	十六、(二)	1,923,241,896.63	2,373,518,396.72
其中：客户备付金	十六、(二)	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
拆出资金			
融出资金	十六、(三)	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	十六、(四)	1,597,339,721.52	1,438,128,667.56
衍生金融资产	十六、(五)		
买入返售金融资产	十六、(六)	3,386,154,097.60	3,667,811,978.64
应收款项		6,124,625.65	9,816,176.34
应收利息	十六、(七)	159,438,610.00	155,112,189.11
存出保证金		9,952,565.11	7,941,490.73
应收股利			
可供出售金融资产	十六、(八)	2,334,615,979.49	2,379,497,153.74
持有待售资产			
持有至到期投资			
长期应收款			
长期股权投资	十六、(九)	696,593,852.93	578,631,710.02
投资性房地产			
固定资产		991,553,675.77	307,665,194.80
在建工程			648,318,365.22
无形资产		24,462,842.17	27,805,343.89
开发支出			
商誉			
递延所得税资产		41,828,490.99	56,687,492.43
其他资产		49,602,378.33	30,830,699.95
<b>资产总计</b>		<b>22,492,131,217.40</b>	<b>25,405,704,227.89</b>





<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款	十六、(十)	1,663,910,000.00	
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			57,720,060.00
衍生金融负债	十六、(五)	1,051,600.00	
卖出回购金融资产款	十六、(十一)	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12
代理买卖证券款	十六、(十二)	6,486,462,752.13	8,670,270,008.76
代理承销证券款		953,688.33	108,297.15
应付职工薪酬		154,172,673.57	201,885,560.97
应交税费		82,040,935.68	103,545,592.85
应付款项		6,432,910.39	7,059,623.08
应付利息		66,614,783.10	158,183,552.16
应付股利			
持有待售负债			
预计负债		541,766.60	13,008,420.00
长期借款			
应付债券	十六、(十三)	1,697,179,834.23	4,200,000,000.00
长期应付款			
长期应付职工薪酬			
专项应付款			
递延所得税负债		7,102,594.96	12,946,930.48
递延收益			
其他负债		145,125,277.44	153,034,318.71
<b>负债合计</b>		<b>13,170,969,961.14</b>	<b>16,199,370,630.28</b>
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		2,473,999,503.00	2,473,999,503.00
其他权益工具			
资本公积		4,089,218,143.16	4,089,218,143.16
减：库存股			
其他综合收益		-9,277,191.17	37,054,547.54
专项储备			
盈余公积		325,621,653.93	284,765,719.16
一般风险准备		1,255,747,445.69	1,174,035,576.15
未分配利润		1,185,851,701.65	1,147,260,108.60
<b>所有者权益（或股东权益）合计</b>		<b>9,321,161,256.26</b>	<b>9,206,333,597.61</b>
<b>负债和所有者权益（或股东权益）总计</b>		<b>22,492,131,217.40</b>	<b>25,405,704,227.89</b>



## (三) 合并利润表

单位：元

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、营业收入</b>		1,384,562,680.80	1,499,611,313.01
手续费及佣金净收入	六、(三十八)	646,690,825.87	1,015,800,768.29
其中：经纪业务手续费净收入		470,973,706.76	654,416,951.33
投资银行业务手续费净收入		88,669,210.48	254,862,656.79
资产管理业务手续费净收入		82,944,214.61	104,388,729.02
利息净收入	六、(三十九)	448,592,200.42	311,222,099.44
投资收益（损失以“-”号填列）	六、(四十)	250,117,596.43	279,954,774.98
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		11,526,468.67	12,042,897.03
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六、(四十二)	32,776,867.02	-123,132,828.95
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,882,698.01	1,959,235.53
其他业务收入	六、(四十三)	5,808,527.37	6,509,086.62
资产处置收益（损失以“-”号填列）	六、(四十一)	69,361.70	7,298,177.10
其他收益	六、(四十四)	2,390,000.00	
<b>二、营业成本</b>		844,846,765.75	855,967,977.08
税金及附加	六、(四十五)	16,201,030.60	45,128,833.96
业务及管理费	六、(四十六)	823,177,639.46	811,596,596.46
资产减值损失	六、(四十七)	5,468,095.69	-757,453.34
其他业务成本			
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		539,715,915.05	643,643,335.93
加：营业外收入	六、(四十八)	11,961,426.73	11,387,037.08
减：营业外支出	六、(四十九)	8,137,535.36	6,601,109.75
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		543,539,806.42	648,429,263.26
减：所得税费用	六、(五十)	131,328,251.18	154,709,507.05
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		412,211,555.24	493,719,756.21
(一) 按经营持续性分类：	-	-	-
1. 持续经营净利润		412,211,555.24	493,719,756.21
2. 终止经营净利润			
(二) 按所有权归属分类：	-	-	-
1. 少数股东损益		1,608,798.88	162,462.70
2. 归属于母公司所有者的净利润		410,602,756.36	493,557,293.51
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-44,599,511.72	-119,714,099.76
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-44,599,511.72	-119,714,099.76
(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		-44,599,511.72	-119,714,099.76
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		-3,783,182.38	-13,605,716.20
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-40,816,329.34	-106,108,383.56
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			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
<b>七、综合收益总额</b>		367,612,043.52	374,005,656.45
归属于母公司所有者的综合收益总额		366,003,244.64	373,843,193.75
归属于少数股东的综合收益总额		1,608,798.88	162,462.70
<b>八、每股收益：</b>			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.17	0.20
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.17	0.20

法定代表人：步国甸 主管会计工作负责人：夏宏建 会计机构负责人：刘宁

#### (四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、营业收入</b>		1,323,717,608.97	1,499,246,460.30
手续费及佣金净收入	十六、(十四)	612,912,799.11	980,293,919.88
其中：经纪业务手续费净收入		442,239,047.15	618,563,876.95
投资银行业务手续费净收入		89,712,952.96	256,789,665.03
资产管理业务手续费净收入		80,237,724.34	103,761,602.26
利息净收入	十六、(十五)	435,793,487.10	312,318,137.56
投资收益（损失以“-”号填列）		234,711,447.00	255,808,250.68
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		11,495,325.29	12,042,897.03
公允价值变动收益（损失以“-”号		35,246,817.42	-66,102,251.83



填列)			
汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-1,882,698.01	1,959,235.53
其他业务收入		6,892,010.11	7,670,991.38
资产处置收益 (损失以“-”号填列)		43,746.24	7,298,177.10
其他收益			
<b>二、营业成本</b>		792,553,755.04	803,241,832.43
税金及附加		15,593,573.96	44,212,267.20
业务及管理费		771,516,898.69	763,800,360.52
资产减值损失		5,443,282.39	-4,770,795.29
其他业务成本			
<b>三、营业利润 (亏损以“-”号填列)</b>		531,163,853.93	696,004,627.87
加：营业外收入		10,872,565.07	11,034,098.22
减：营业外支出		7,360,473.19	6,507,012.88
<b>四、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		534,675,945.81	700,531,713.21
减：所得税费用		126,116,598.15	167,774,024.33
<b>五、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		408,559,347.66	532,757,688.88
(一) 持续经营净利润		408,559,347.66	532,757,688.88
(二) 终止经营净利润			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-46,331,738.71	-177,574,755.54
(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		-46,331,738.71	-177,574,755.54
1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额		-3,783,182.38	-13,605,716.20
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-42,548,556.33	-163,969,039.34
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			
<b>七、综合收益总额</b>		362,227,608.95	355,182,933.34
<b>八、每股收益：</b>			
(一) 基本每股收益 (元/股)		0.17	0.22



(二) 稀释每股收益(元/股)		0.17	0.22
-----------------	--	------	------

## (五) 合并现金流量表

单位: 元

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量:</b>			
购买及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产收到的现金净额		221,073,718.62	1,696,257,589.89
收取利息、手续费及佣金的现金		1,908,410,501.71	2,615,764,569.23
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		477,738,677.41	
融出资金净减少额			2,351,197,729.97
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	六、(五十一)	98,724,068.3	4,369,847,015.3
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>2,705,946,966.04</b>	<b>11,033,066,904.42</b>
购买及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产支付的现金净额			
拆入资金净减少额			300,000,000.00
回购业务支付的现金净额			6,915,947,220.37
融出资金净增加额		52,956,930.67	
代理买卖证券支付的现金净额		2,306,012,755.24	4,979,711,155.02
支付利息、手续费及佣金的现金		345,489,142.37	501,229,219.89
支付给职工以及为职工支付的现金		569,002,450.64	574,528,968.09
支付的各项税费		225,716,293.63	464,650,361.83
支付其他与经营活动有关的现金	六、(五十二)	263,485,526.08	394,455,520.40
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>3,762,663,098.63</b>	<b>14,130,522,445.60</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>-1,056,716,132.59</b>	<b>-3,097,455,541.18</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量:</b>			
收回投资收到的现金			
取得投资收益收到的现金			
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	六、(五十三)	227,897.77	164,037.06
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>227,897.77</b>	<b>164,037.06</b>
投资支付的现金		137,250,000.00	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		64,235,059.01	182,234,885.37
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		-	
<b>投资活动现金流出小计</b>		201,485,059.01	182,234,885.37
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-201,257,161.24	-182,070,848.31
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			2,700,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			2,700,000.00
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		2,670,010,000.00	
收到其他与筹资活动有关的现金	六、(五十四)	300,000,000.00	186,970,000.00
<b>筹资活动现金流入小计</b>		2,970,010,000.00	189,670,000.00
偿还债务支付的现金		3,516,100,000.00	1,717,950,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		573,110,968.16	750,508,498.03
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金	六、(五十五)	618,962,776.75	135,659,548.44
<b>筹资活动现金流出小计</b>		4,708,173,744.91	2,604,118,046.47
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-1,738,163,744.91	-2,414,448,046.47
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-1,882,698.01	1,959,235.53
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		-2,998,019,736.75	-5,692,015,200.43
加：期初现金及现金等价物余额		11,134,854,750.24	16,826,869,950.67
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		8,136,835,013.49	11,134,854,750.24

法定代表人：步国甸 主管会计工作负责人：夏宏建 会计机构负责人：刘宁

#### (六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	本期发生额	上期发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
购买及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产收到的现金净额			1,811,031,219.89
收取利息、手续费及佣金的现金		1,797,484,056.31	2,483,563,227.81
拆入资金净增加额		-	
回购业务资金净增加额		515,219,341.21	
融出资金净减少额			2,351,197,729.97
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		47,423,751.11	4,477,261,245.15
<b>经营活动现金流入小计</b>		2,360,127,148.63	11,123,053,422.82
购买及处置以公允价值计量且其变动		176,991,890.65	





计入当期损益的金融资产支付的现金净额			
拆入资金净减少额			300,000,000.00
回购业务支付的现金净额			6,850,247,220.37
融出资金净增加额		52,956,930.67	
代理买卖证券支付的现金净额		2,183,807,256.63	5,129,476,916.14
支付利息、手续费及佣金的现金		348,149,898.06	501,947,106.12
支付给职工以及为职工支付的现金		538,642,002.24	547,548,848.38
支付的各项税费		215,953,265.52	455,880,264.59
支付其他与经营活动有关的现金		249,204,503.09	220,089,158.77
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>3,765,705,746.86</b>	<b>14,005,189,514.37</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>-1,405,578,598.23</b>	<b>-2,882,136,091.55</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			
取得投资收益收到的现金		14,100,000.00	
收到其他与投资活动有关的现金		163,653.67	164,037.06
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>14,263,653.67</b>	<b>164,037.06</b>
投资支付的现金		110,250,000.00	200,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		61,861,435.53	179,998,348.51
支付其他与投资活动有关的现金			
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>172,111,435.53</b>	<b>379,998,348.51</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-157,847,781.86</b>	<b>-379,834,311.45</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
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		2,680,010,000.00	
收到其他与筹资活动有关的现金			
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>2,680,010,000.00</b>	<b>-</b>
偿还债务支付的现金		3,516,100,000.00	1,717,950,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		551,392,369.40	750,508,498.03
支付其他与筹资活动有关的现金		3,000,000.00	
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>4,070,492,369.40</b>	<b>2,468,458,498.03</b>
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-1,390,482,369.40</b>	<b>-2,468,458,498.03</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>-1,882,698.01</b>	<b>1,959,235.53</b>
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		<b>-2,955,791,447.50</b>	<b>-5,728,469,665.50</b>
加：期初现金及现金等价物余额		10,578,530,591.76	16,307,000,257.26
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		<b>7,622,739,144.26</b>	<b>10,578,530,591.76</b>



## (七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	本期												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他										
一、上年期末余额	2,473,999,503.00				4,072,448,984.89		34,231,524.41		284,765,719.16	1,177,170,128.32	1,205,414,032.52	32,012,779.48	9,280,042,671.78
加：会计政策变更													
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年期初余额	2,473,999,503.00				4,072,448,984.89		34,231,524.41		284,765,719.16	1,177,170,128.32	1,205,414,032.52	32,012,779.48	9,280,042,671.78
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)							-44,599,511.72		40,855,934.77	82,537,300.62	39,809,570.67	1,608,798.88	120,212,093.22
(一) 综合收益总额							-44,599,511.72				410,602,756.36	1,608,798.88	367,612,043.52
(二) 所有者投入和减少资本													
1. 股东投入的普通股													
2. 其他权益工具持有													



者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他												
(三) 利润分配							40,855,934.77	82,537,300.62	-370,793,185.69	-	-247,399,950.30	
1. 提取盈余公积							40,855,934.77		-40,855,934.77		-	
2. 提取一般风险准备								82,537,300.62	-82,537,300.62		-	
3. 对所有者（或股东）的分配									-247,399,950.30		-247,399,950.30	
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
<b>四、本年期末余额</b>	2,473,999,503.00	-	-	-	4,072,448,984.89	-	-10,367,987.31	325,621,653.93	1,259,707,428.94	1,245,223,603.19	33,621,578.36	9,400,254,765.00



项目	上期												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他										
一、上年期末余额	2,473,999,503.0				4,072,448,984.89		153,945,624.17		231,489,950.27	1,069,691,935.20	1,243,710,626.47	29,150,316.78	9,274,436,940.78
加：会计政策变更													
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年期初余额	2,473,999,503.00				4,072,448,984.89		153,945,624.17		231,489,950.27	1,069,691,935.20	1,243,710,626.47	29,150,316.78	9,274,436,940.78
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）							-119,714,099.76		53,275,768.89	107,478,193.12	-38,296,593.95	2,862,462.70	5,605,731.00
（一）综合收益总额							-119,714,099.76				493,557,293.51	162,462.70	374,005,656.45
（二）所有者投入和减少资本												2,700,000.00	2,700,000.00
1. 股东投入的普通股												2,700,000.00	2,700,000.00
2. 其他权益工具持有者投入资本													
3. 股份支付计入所有者权益的金额													
4. 其他													
（三）利润分配									53,275,768.89	107,478,193.12	-531,853,887.46		-371,099,925.45
1. 提取盈余公积									53,275,768.89		-53,275,768.89		-
2. 提取一般风险准备										107,478,193.12	-107,478,193.12		-
3. 对所有者（或股东）的分配											-371,099,925.45		-371,099,925.45



4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
<b>四、本年期末余额</b>	2,473,999,503.00		4,072,448,984.89		34,231,524.41	284,765,719.16	1,177,170,128.32	1,205,414,032.52	32,012,779.48	9,280,042,671.78		
(三) 利润分配						53,275,768.89	107,478,193.12	<b>-531,853,887.46</b>		-371,099,925.45		
1. 提取盈余公积						53,275,768.89		-53,275,768.89		-		
2. 提取一般风险准备							107,478,193.12	-107,478,193.12		-		
3. 对所有者（或股东）的分配								-371,099,925.45		-371,099,925.45		
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												



四、本年期末余额	2,473,999,503.00			4,072,448,984.89		34,231,524.41		284,765,719.16	1,177,170,128.32	1,205,414,032.52	32,012,779.48	9,280,042,671.78
----------	------------------	--	--	------------------	--	---------------	--	----------------	------------------	------------------	---------------	------------------

法定代表人：步国旬 主管会计工作负责人：夏宏建 会计机构负责人：刘宁

(八) 母公司股东权益变动表

单位：元

项目	本期											
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	2,473,999,503.00				4,089,218,143.16		37,054,547.54		284,765,719.16	1,174,035,576.15	1,147,260,108.60	9,206,333,597.61
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	2,473,999,503.00				4,089,218,143.16		37,054,547.54		284,765,719.16	1,174,035,576.15	1,147,260,108.60	9,206,333,597.61
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）							-46,331,738.71		40,855,934.77	81,711,869.54	38,591,593.05	114,827,658.65
（一）综合收益总额							-46,331,738.71				408,559,347.66	362,227,608.95
（二）所有者投入和减少资本												
1. 股东投入的普通股												
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益												





的金额												
4. 其他												
(三) 利润分配								40,855,934.77	81,711,869.54	-369,967,754.61	-247,399,950.30	
1. 提取盈余公积								40,855,934.77		-40,855,934.77	-	
2. 提取一般风险准备									81,711,869.54	-81,711,869.54	-	
3. 对所有者（或股东）的分配										-247,399,950.30	-247,399,950.30	
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
<b>四、本年期末余额</b>	2,473,999,503.00	-	-	-	4,089,218,143.16	-	-9,277,191.17	325,621,653.93	1,255,747,445.69	1,185,851,701.65	9,321,161,256.26	

项目	上期											
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先	永续	其他								



		股	债								
一、上年期末余额	2,473,999,503.00			4,089,218,143.16		214,629,303.08		231,489,950.27	1,067,484,038.37	1,145,429,651.84	9,222,250,589.72
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	2,473,999,503.00			4,089,218,143.16		214,629,303.08		231,489,950.27	1,067,484,038.37	1,145,429,651.84	9,222,250,589.72
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）						-177,574,755.54		53,275,768.89	106,551,537.78	1,830,456.76	-15,916,992.11
（一）综合收益总额						-177,574,755.54				532,757,688.88	355,182,933.34
（二）所有者投入和减少资本											
1. 股东投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
（三）利润分配								53,275,768.89	106,551,537.78	-530,927,232.12	-371,099,925.45
1. 提取盈余公积								53,275,768.89		-53,275,768.89	-
2. 提取一般风险准备									106,551,537.78	-106,551,537.78	-
3. 对所有者（或股东）的分配										-371,099,925.45	-371,099,925.45
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股											



本)												
2. 盈余公积转增资本(或股本)												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
<b>四、本年期末余额</b>	2,473,999,503.00	-	-	-	4,089,218,143.16	-	37,054,547.54		284,765,719.16	1,174,035,576.15	1,147,260,108.60	9,206,333,597.61

## 南京证券股份有限公司 2017 年度财务报表附注

### 一、 公司基本情况

#### (一) 公司概况

南京证券股份有限公司（以下简称“本公司”）前身为南京市证券公司，于 1990 年经中国人民银行银复【1990】356 号文批准成立，注册资本为人民币 1,000.00 万元。1996 年中国人民银行银办函【1996】391 号文同意本公司将资本金增至人民币 10,470.00 万元，1998 年经中国证券监督管理委员会证监机字【1998】45 号文核准，本公司更名为“南京证券有限责任公司”。2002 年经中国证券监督管理委员会证监机构字【2002】344 号批复及宁永会二验字【2002】036 号验资报告验证，注册资本增加到人民币 658,590,250.79 元。2006 年经中国证券监督管理委员会证监机构字【2006】218 号批复及宁永会验字【2006】第 0071 号验资报告验证，注册资本增加到人民币 1,022,282,250.79 元。2008 年 8 月，经中国证券监督管理委员会证监许可【2008】1073 号《关于核准南京证券有限责任公司变更注册资本的批复》及宁信会验字（2008）0059 号验资报告验证，注册资本增加到人民币 1,771,051,950.79 元。2011 年 9 月，经中国证券监督管理委员会江苏监管局苏证监机构字【2011】508 号《关于核准南京证券公司变更注册资本的批复》及宁信会验字【2011】0111 号验资报告验证，注册资本增加到人民币 1,879,051,950.79 元。

经本公司 2011 年第四次临时股东会会议决议并经中国证券监督管理委员会 2012 年 9 月 12 日下发的证监许可【2012】1217 号《关于核准南京证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》批准，本公司整体变更为南京证券股份有限公司，注册资本为人民币 190,000.00 万元，由全体股东以截至 2011 年 9 月 30 日经审计后的公司净资产折股。2012 年 9 月 29 日本公司已经换领南京证券股份有限公司的企业法人营业执照。

2015 年 10 月，经全国中小企业股份转让系统有限责任公司股转系统函【2015】6423 号《关于同意南京证券股份有限公司股票在全国中小企业股份转让系统挂牌的函》文件批准，本公司股票在全国中小企业股份转让系统挂牌，转让方式为协议转让。

经本公司第一届董事会第二十八次会议、2015 年第五次临时股东会会议决议及信会师报字【2015】第 520116 号验资报告验证，本公司向南京紫金投资集团有限责任公司、南京新工投资集团有限责任公司等 23 家原股东和南京东南国资投资集团有限责任公司、南京国资新城投资置业有限责任公司等 8 家新增投资者定向增发股份 573,999,503.00 股，募集资金人民币 3,443,997,018.00 元，其中增加注册资本人民币 573,999,503.00 元，增发后注册资本为人民币 2,473,999,503.00 元。2015 年 11 月 16 日本公司取得了变更后的营业执照。

本公司注册地：南京市江东中路 389 号；法定代表人：步国旬；统一社会信用代码：91320100134881536B。

## (二) 行业性质和主要产品

本公司行业性质为金融企业，主要业务板块为金融证券业。

## (三) 经营范围

- 1、南京证券股份有限公司：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；融资融券；证券资产管理；证券投资基金代销；代销金融产品；为期货公司提供中间介绍业务。
- 2、南京巨石创业投资有限公司：股权投资、股权投资的财务顾问服务；设立直投资基金，进行股权投资；将闲置资金投资于依法公开发行的国债、投资级公司债、货币市场基金、央行票据等风险较低、流动性较强的证券，以及证券投资基金、集合资产管理计划或者专项资产管理计划。
- 3、南京巨石金川股权投资基金管理有限公司：受托管理私募股权投资基金，从事投资管理及相关咨询服务业务。
- 4、宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司：股权投资、债权投资、投资与股权投资、债权投资相关的投资基金、受托管理私募股权投资基金、从事投资管理及相关咨询服务业务（不得从事非法集资、吸收公众资金等金融活动）。
- 5、南证期货有限责任公司：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理。
- 6、宁夏股权托管交易中心（有限公司）：为企业办理股权集中登记托管，提供确权、非交易过户、挂失、查询、分红派息和股权质押登记服务；为企业股权、债权、资产支持证券和其他权益类产品及金融产品的挂牌、交易、鉴证、过户、结算及咨询和信息发布等提供场所、设施和服务；为企业和投资人提供相关培训、财务顾问、受托资产管理、投资管理服务；其他经监管部门核准的业务。

## (四) 合并财务报表范围

本期本公司纳入合并财务报表范围子公司明细如下：

子公司/特殊目的主体名称	合并情况	
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
南京巨石创业投资有限公司	合并	合并
南京巨石金川股权投资基金管理有限公司	合并	合并
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	合并	合并
南证期货有限责任公司	合并	合并
宁夏股权托管交易中心（有限公司）	合并	合并
南京证券神州 4 号股票精选集合资产管理计划	合并	合并
北信利通债券投资集合资金信托第 2 期投资组合	/	合并
龙兴 506 号定向资产管理计划	/	合并
尚书 1 号定向资产管理计划	/	合并
宝通 3 号集合资金信托计划	/	合并
宝通 2 号集合资金信托计划	合并	合并
富安达-南证量化 1 号资产管理计划	合并	/

本期合并财务报表范围及其变化情况详见本附注“七、合并范围的变更”和“八、在其他主体中的权益”。

#### (五) 本期财务报表主体及其确定方法

会计期间	财务报表主体	确定方法
2017 年度	南京证券股份有限公司	以实际法律框架确定
2016 年度	南京证券股份有限公司	以实际法律框架确定

#### (六) 本期所有者权益变动情况（单位：元）

项目	期末余额	年初余额
股本	2,473,999,503.00	2,473,999,503.00
资本公积	4,072,448,984.89	4,072,448,984.89
其他综合收益	-10,367,987.31	34,231,524.41
盈余公积	325,621,653.93	284,765,719.16
一般风险准备	1,259,707,428.94	1,177,170,128.32
未分配利润	1,245,223,603.19	1,205,414,032.52
归属于母公司所有者权益	9,366,633,186.64	9,248,029,892.30
少数股东权益	33,621,578.36	32,012,779.48
所有者权益合计	9,400,254,765.00	9,280,042,671.78

#### (七) 本公司营业网点及人员数量

截至 2017 年 12 月 31 日，本公司（包括纳入合并范围子公司）聘用员工 1718 人，其中母公司管理人员 214 人。本公司下设分公司 15 家，即南京证券股份有限公司宁夏分公司、南京证券股份有限公司深圳分公司、南京证券股份有限公司上海分公司、南京证券股份有限公司连云港分公司、南京证券股份有限公司盐城分公司、南京证券股份有限公司南通分公司、南京证券股份有限公司



镇江分公司、南京证券股份有限公司北京分公司、南京证券股份有限公司无锡分公司、南京证券股份有限公司苏州分公司、南京证券股份有限公司云南分公司、南京证券股份有限公司常州分公司、南京证券股份有限公司重庆分公司、南京证券股份有限公司江西分公司、南京证券股份有限公司南京分公司；本公司下设证券营业部 86 家。

## 二、 财务报表的编制基础及遵循企业会计准则的声明

### (一) 财务报表的编制基础

本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”）、财政部财会【2013】26 号《关于印发<证券公司财务报表格式和附注>的通知》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）和《证券公司年度报告内容与格式准则》（2013 年）的披露规定编制财务报表。

### (二) 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、完整地反映了报告期本公司的财务状况、经营成果、现金流量等有关信息。

## 三、 主要会计政策、会计估计

### (一) 会计期间

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止为一个会计年度。

### (二) 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

### (三) 营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

### (四) 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资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。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。

## 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。

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直接相关费用，于发生时计入当期损益；为企业合并而发行权益性证券的交易费用，冲减权益。

## (五) 合并财务报表的编制方法

### 1、 合并范围

本公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，所有子公司（包括本公司所控制的被投资方可分割的部分）均纳入合并财务报表。

### 2、 合并程序

本公司以自身和各子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，编制合并财务报表。本公司编制合并财务报表，将整个企业集团视为一个会计主体，依据相关企业会计准则的确认、计量和列报要求，按照统一的会计政策，反映本企业集团整体财务状况、经营成果和现金流量。

所有纳入合并财务报表合并范围的子公司所采用的会计政策、会计期间与本公司一致，如子公司采用的会计政策、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。对于同一控制下企业合并取得的子公司，以其资产、负债（包括最终控制方收购该子公司而形成的商誉）在最终控制方财务报表中的账面价值为基础对其财务报表进行调整。

子公司所有者权益、当期净损益和当期综合收益中属于少数股东的份额分别在合并资产负债表中所有者权益项目下、合并利润表中净利润项目下和综合收益总额项目下单独列示。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。

#### （1）增加子公司或业务

在报告期内，若因同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则调整合并资产负债表的当期期初数；将子公司或业务合并当期期初至当期期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；将子公司或业务合并当期期初至当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自最终控制方开始控制时点起一直存在。因追加投资等原因能够对同一控制下的被投资方实施控制的，视同参与合并的各方在最终

控制方开始控制时即以目前的状态存在进行调整。在取得被合并方控制权之前持有的股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一控制之日孰晚日起至合并日之间已确认有关损益、其他综合收益以及其他净资产变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

在报告期内，若因非同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则不调整合并资产负债表期初数；将该子公司或业务自购买日至当期期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司或业务自购买日至当期期末的现金流量纳入合并现金流量表。

因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资方实施控制的，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权益法核算下的其他综合收益以及除净损益、其他综合收益和利润分配之外的其他所有者权益变动的，与其相关的其他综合收益、其他所有者权益变动转为购买日所属当期投资收益，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。

## （2）处置子公司或业务

### ①一般处理方法

在报告期内，本公司处置子公司或业务，则该子公司或业务期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司或业务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被投资方控制权时，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或合并日开始持续计算的净资产的份额与商誉之和的差额，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或除净损益、其他综合收益及利润分配之外的其他所有者权益变动，在丧失控制权时转为当期投资收益，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。

### ②分步处置子公司

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，通常表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：

- i. 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；
- ii. 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；
- iii. 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；
- iv. 一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易属于一揽子交易的，本公司将各项交易

作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易不属于一揽子交易的，在丧失控制权之前，按不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资的相关政策进行会计处理；在丧失控制权时，按处置子公司一般处理方法进行会计处理。

### (3) 购买子公司少数股权

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自购买日（或合并日）开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整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。

### (4) 不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资

在不丧失控制权的情况下，因部分处置对子公司的长期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自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整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。

## (六) 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。

## (七) 客户交易结算资金

本公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，与自有资金分开管理，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

本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。

本公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

## (八) 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。

资产负债表日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。

## 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折算。

处置境外经营时，将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。

## (九) 金融工具

金融工具包括金融资产、金融负债和权益工具。

### 1、 金融工具的分类

金融资产和金融负债于初始确认时分类为：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，包括交易性金融资产或金融负债和直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债；持有至到期投资；应收款项；可供出售金融资产；其他金融负债等。金融资产的分类取决于本公司及其子公司对金融资产的持有意图和持有能力。

### 2、 金融工具的确认依据和计量方法

#### (1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（金融负债）

取得时以公允价值（扣除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）作为初始确认金额，相关的交易费用计入当期损益。

持有期间将取得的利息或现金股利确认为投资收益，期末将公允价值变动计入当期损益。

处置时，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

取得时按公允价值（扣除已到付息期但尚未领取的债券利息）和相关交易费用之和作为初始确认金额。

持有期间按照摊余成本和实际利率（如实际利率与票面利率差别较小的，按票面利率）计算确认利息收入，计入投资收益。实际利率在取得投资时确定，在该预期存续期间或适用的更短期间内保持不变。

处置时，将所取得价款与该投资账面价值之间的差额计入投资收益。

(3) 应收款项

本公司对外销售商品或提供劳务形成的应收债权，以及本公司持有的其他企业的不包括在活跃市场上有报价的债务工具的债权，包括应收账款、其他应收款等，以向购货方应收的合同或协议价款作为初始确认金额；具有融资性质的，按其现值进行初始确认。

收回或处置时，将取得的价款与该应收款项账面价值之间的差额计入当期损益。

(4) 可供出售金融资产

取得时按公允价值（扣除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）和相关交易费用之和作为初始确认金额。

持有期间将取得的利息或现金股利确认为投资收益。期末以公允价值计量且将公允价值变动计入其他综合收益。但是，在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

处置时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资损益；同时，将原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入当期损益。

(5) 其他金融负债

按其公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。采用摊余成本进行后续计量。

### 3、 金融资产转移的确认依据和计量方法

本公司发生金融资产转移时，如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，则终止确认该金融资产；如保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，则不终止确认该金融资产。

在判断金融资产转移是否满足上述金融资产终止确认条件时，采用实质重于形式的原则。本公司将金融资产转移区分为金融资产整体转移和部分转移。金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 所转移金融资产的账面价值；

(2) 因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 终止确认部分的账面价值；

(2) 终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

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，所收到的对价确认为一项金融负债。



#### 4、 金融负债终止确认条件

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，则终止确认该金融负债或其一部分；本公司若与债权人签定协议，以承担新金融负债方式替换现存金融负债，且新金融负债与现存金融负债的合同条款实质上不同的，则终止确认现存金融负债，并同时确认新金融负债。

对现存金融负债全部或部分合同条款作出实质性修改的，则终止确认现存金融负债或其一部分，同时将修改条款后的金融负债确认为一项新金融负债。

金融负债全部或部分终止确认时，终止确认的金融负债账面价值与支付对价（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。

本公司若回购部分金融负债的，在回购日按照继续确认部分与终止确认部分的相对公允价值，将该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给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。

#### 5、 公允价值计量

存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值，活跃市场的报价包括易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格。不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。在估值时，本公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，选择与市场参与者在相关资产或负债的交易中所考虑的资产或负债特征相一致的输入值，并优先使用相关可观察输入值。只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。本公司使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

公允价值的估值原则为：

股票类金融资产：首次发行未上市的股票，以发行价计算；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价为基础进行估值；已上市流通股按照期末收盘价作为公允价值。

基金类金融资产：封闭型基金，其公允价值参照成份类股票公允价值的计算方法；开放式基金及集合资产管理计划等，以资产负债表日公布的最新净值计算公允价值。

证券交易所上市债券类金融资产：包括国债、企业债、可转债、金融债等，按最近收盘价作为公允价值。

银行间市场和场外交易债券类金融资产：包括国债、企业债、短期融资券、特种金融债和中央银行票据等，按中债估值计算。

信托产品类金融资产：有交易价的，按收盘价作为公允价值；无交易价的，按信托产品估值作为公允价值。

创设发行认购权证时，应按实际收到的款项，反映为交易性金融负债，期末，认购权证按

认购权证最后一个交易日的加权平均价计量，前后两个会计期末加权平均价的差额应当计入当期损益；如遇认购权证的加权平均价显著偏离按 B-S 期权定价模型计算确定的价值，本公司按 B-S 期权定价模型计算确定的价值计量。

创设发行认沽权证时，应按实际收到的款项，反映为“交易性金融负债”，会计期末，认沽权证按认沽权证最后一个交易日的加权平均价计量，前后两个会计期末加权平均价的差额应当计入当期损益；如遇认沽权证的加权平均价显著偏离按 B-S 期权定价模型计算确定的价值，本公司按 B-S 期权定价模型计算确定的价值计量。

## 6、 金融资产（不含应收款项）减值

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。按摊余成本计量的金融资产，期末有客观证据表明其发生了减值的，根据其账面价值高于预计未来现金流量现值之间的差额确认减值损失。在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，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减值时，将该权益工具投资或衍生金融资产的账面价值，高于按照类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额，确认为减值损失。

表明可供出售金融资产发生减值的客观证据

①表明可供出售债务工具投资发生减值的客观证据包括：

债务人发生严重财务困难；

债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金发生违约或逾期；

公司出于经济或法律等方面因素的考虑，对发生财务困难的债务人作出让步；

债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；

因债务人发生重大财务困难，该债务工具无法在活跃市场继续交易；

其他表明可供出售债务工具发生减值的情况。

②表明可供出售权益工具投资发生减值的客观证据包括权益工具投资的公允价值发生严重或非暂时性下跌。本公司于资产负债表日对各项可供出售权益工具投资单独进行检查，如果单项可供出售金融资产权益工具的公允价值出现较大幅度下降，超过其持有成本的 50%，则可认定该可供出售金融资产已发生减值，应计提减值准备，确认减值损失；如果单项可供出售金融资产权益工具公允价值持续下降，虽没有达到上述降幅，但本公司在综合考虑各种相关因素（包括但不限于公允价值波动幅度、下降幅度、趋势等）后，预期这种下降趋势属于非暂时性的且持续下跌时间达一年以上，也可以认定该可供出售权益工具投资已发生减值，应计提减值准备，确认其减值损失。

上段所述“成本”按照可供出售权益工具投资的初始取得成本扣除已收回本金和已摊销金额确定；“公允价值”根据证券交易所期末收盘价确定，除非该项可供出售权益工具投资存在限售期。

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

## 7、 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。

除现金流量套期中属于有效套期的部份计入其他综合收益并于被套期项目影响损益时转出计入当期损益之外，衍生金融工具公允价值变动直接计入当期损益。普通的衍生金融工具主要基于市场普遍采用的估值模型计算公允价值。估值模型的数据尽可能采用可观察市场信息。复杂的结构性衍生金融工具的公允价值主要来源于交易商报价。

## (十) 坏账准备的确认标准和计提方法

### 1、 坏账的确认标准

坏账是本公司无法收回或者收回的可能性极小的应收款项。本公司由于发生呆账、坏账而产生的损失，经批准后确认为坏账损失，其确认标准为：

- A. 如债务人被依法宣告破产、撤销，其剩余财产确实不足清偿的应收款项；
- B. 债务人死亡或者依法被宣告死亡、失踪，既无遗产可供清偿，又无义务承担人，确实无法收回的款项；
- C. 债务人遭受重大自然灾害或者意外事故，损失巨大，以及财产（包括保险赔款等）确实无法清偿的应收款项；
- D. 债务人逾期未履行偿债义务，经法院裁决，确实无法清偿的应收款项；
- E. 其他有确凿证据表明确实无法收回的应收款项等。

### 2、 坏账损失的核算方法

采用备抵法核算。

### 3、 坏账准备的计提方法

（1） 单项金额重大并单项计提坏账准备的确认标准、计提方法

本公司对金额为人民币 1000 万元（含 1000 万元）以上的应收款项确认为单项金额重大的应收款项。单项金额重大的应收款项应单独进行减值测试。有客观证据表明其发生了减值的，应当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，计提坏账准备。

单项测试未发生减值的应收款项包括在具有类似信用风险特征的资产组合中进行减值测试。单项测试已确认减值损失的应收款项不再包括在具有类似信用风险特征的应收款项组合中进行减值测试。

(2) 按信用风险特征组合计提坏账准备的应收款项的确认依据、坏账准备计提方法

**A、信用风险特征组合的确认依据**

项目	确定组合的依据
账龄组合	以账龄确定组合
特定款项组合	应收款项中与证券交易结算相关的款项、金融资产申购款、购房预付款等

**B、根据信用风险特征组合确定的坏账准备计提方法**

项目	确定组合的依据
账龄组合	账龄分析法计提坏账准备
特定款项组合	单独测试，无特别风险的不计提

**组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的组合计提方法**

账龄	确定组合的依据
1 年以内（含 1 年，下同）	0.30%
1-2 年	10.00%
2-3 年	20.00%
3 年以上	100.00%

(3) 单项金额不重大但单项计提坏账准备的应收款项

本公司对单项金额不重大但具备以下特征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，计提坏账准备，包括：与对方存在争议或涉及诉讼、仲裁的应收款项；已有明显迹象表明债务人很可能无法履行还款义务的应收款项。

(4) 融出资金的坏账准备计提方法

融资融券业务形成的债权采用以下方法计提坏账准备：资产负债表日未能按期收回并已形成风险的融资类债权（涉及科目为融出资金、约定购回和股票质押回购方式形成的买入返售金融资产）按照个别认定法，单独进行减值测试。未按期收回融资类债权转入应收融资融券款超过 30 天，且该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。单独测试未发生减值的以及未形成风险的融资类债权，按照资产负债表日融资余额的 3%计提坏账准备。

**(十一) 长期股权投资**

**1、 共同控制、重大影响的判断标准**

共同控制，是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。本公司与其他合营方一同对被投资单位实施共同控制且对被投资单位净资产享有权利的，被投资单位为本公司的合营企业。

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。本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、 初始投资成本的确定

### （1）企业合并形成的长期股权投资

同一控制下企业合并：本公司以支付现金、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。因追加投资等原因能够对同一控制下的被投资单位实施控制的，在合并日根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额，确定长期股权投资的初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整股本溢价，股本溢价不足冲减的，冲减留存收益。

非同一控制下企业合并：本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。因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，按照原持有的股权投资账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

### （2）其他方式取得的长期股权投资

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。

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。

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和应支付的相关税费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。

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

本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，本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。

本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，并按照本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。

本公司与联营企业、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。

在本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。

### （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。

## (十二) 投资性房地产

投资性房地产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产，包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权、已出租的建筑物（含自行建造或开发活动完成后用于出租的建筑物以及正在建造或开发过程中将来用于出租的建筑物）。

本公司对现有投资性房地产采用成本模式计量。对按照成本模式计量的投资性房地产一出租用建筑物采用与本公司固定资产相同的折旧政策，出租用土地使用权按与无形资产相同的摊销政策执行。

本公司对存在减值迹象的，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。

投资性房地产减值损失一经确认，不再转回。

## (十三) 固定资产的计价和折旧方法

### 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，并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在同时满足下列条件时予以确认：

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

### 2、 固定资产的分类

本公司固定资产分类为：房屋及建筑物、运输设备、电子及办公设备。

### 3、 固定资产的初始计量

固定资产取得时按照实际成本进行初始计量。

外购固定资产的成本，以购买价款、相关税费、使固定资产达到预定可使用状态前所发生的可归属于该项资产的运输费、装卸费、安装费和专业人员服务费等确定。

自行建造固定资产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。债务重组取得债务人用以抵债的固定资产，以该固定资产的公允价值为基础确定其入账价

值，并将重组债务的账面价值与该用以抵债的固定资产公允价值之间的差额，计入当期损益。

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，换入的固定资产以换出资产的公允价值为基础确定其入账价值，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固定资产的成本，不确认损益。

以同一控制下的企业吸收合并方式取得的固定资产按被合并方的账面价值确定其入账价值；以非同一控制下的企业吸收合并方式取得的固定资产按公允价值确定其入账价值。

#### 4、 固定资产折旧计提方法

根据固定资产原值、扣除残值按预计使用年限，采用直线法分类计提。已计提固定资产减值的固定资产按提取固定资产减值后的固定资产价值在剩余尚可使用年限内提取折旧。各类固定资产的使用年限、净残值率、年折旧率如下：

类别	折旧年限	预计净残值率	年折旧率
房屋及建筑物	10-35 年	3%	2.77%-9.70%
运输设备	6 年	3%	16.17%
电子及办公设备	3-5 年	3%	19.40%-32.33%

#### 5、 固定资产的处置

固定资产出售、转让、报废的处置收入扣除其账面价值后的差额计入当期损益。

#### 6、 固定资产的减值测试方法、减值准备计提方法

本公司在每期末判断固定资产是否存在可能发生减值的迹象。

固定资产存在减值迹象的，估计其可收回金额。可收回金额根据固定资产的公允价值减去处置费用后的净额与固定资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定。

当固定资产的可收回金额低于其账面价值的，将固定资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为固定资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的固定资产减值准备。

固定资产减值损失确认后，减值固定资产的折旧在未来期间作相应调整，以使该固定资产在剩余使用寿命内，系统地分摊调整后的固定资产账面价值（扣除预计净残值）。

固定资产的减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

有迹象表明一项固定资产可能发生减值的，企业以单项固定资产为基础估计其可收回金额。

企业难以对单项固定资产的可收回金额进行估计的，以该固定资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。

#### (十四) 在建工程核算方法

### 1、 在建工程类别

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。所建造的固定资产在建工程已达到预定可使用状态，但尚未办理竣工决算的，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。

### 3、 在建工程的减值测试方法、减值准备计提方法

本公司在每期末判断在建工程是否存在可能发生减值的迹象。

在建工程存在减值迹象的，估计其可收回金额。有迹象表明一项在建工程可能发生减值的，企业以单项在建工程为基础估计其可收回金额。企业难以对单项在建工程的可收回金额进行估计的，以该在建工程所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。

可收回金额根据在建工程的公允价值减去处置费用后的净额与在建工程预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定。

当在建工程的可收回金额低于其账面价值的，将在建工程的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为在建工程减值损失，计入当期损益，同时计提相应的在建工程减值准备。

在建工程的减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

## (十五) 长期待摊费用的核算方法

长期待摊费用指已经支出但受益期限在 1 年以上（不含 1 年）的各项费用，以实际发生额入账，按受益期限平均摊销，其中：

预付经营租入固定资产的租金，按租赁合同规定的期限平均摊销。

经营租赁方式租入的固定资产改良支出，按剩余租赁期与租赁资产尚可使用年限两者中较短的期限平均摊销。

## (十六) 借款费用

### 1、 借款费用资本化的确认原则

借款费用，包括借款利息、折价或者溢价的摊销、辅助费用以及因外币借款而发生的汇兑差额等。

本公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时根据其发生额确认为费用，计入当期

损益。

符合资本化条件的资产，是指需要经过相当长时间的购建或者生产活动才能达到预定可使用或者可销售状态的固定资产、投资性房地产和存货等资产。

借款费用同时满足下列条件时开始资本化：

- (1) 资产支出已经发生，资产支出包括为购建或者生产符合资本化条件的资产而以支付现金、转移非现金资产或者承担带息债务形式发生的支出；
- (2) 借款费用已经发生；
- (3) 为使资产达到预定可使用或者可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

## 2、 借款费用资本化期间

资本化期间，指从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间，借款费用暂停资本化的期间不包括在内。

当购建或者生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或者可销售状态时，借款费用停止资本化。

当购建或者生产符合资本化条件的资产中部分项目分别完工且可单独使用时，该部分资产借款费用停止资本化。

购建或者生产的资产各部分分别完工，但必须等到整体完工后才可使用或可对外销售的，在该资产整体完工时停止借款费用资本化。

## 3、 暂停资本化期间

符合资本化条件的资产在购建或生产过程中发生的非正常中断、且中断时间连续超过 3 个月的，则借款费用暂停资本化；该项中断如是所购建或生产的符合资本化条件的资产达到预定可使用状态或者可销售状态必要的程序，则借款费用继续资本化。在中断期间发生的借款费用确认为当期损益，直至资产的购建或者生产活动重新开始后借款费用继续资本化。

## 4、 借款费用资本化金额的计算方法

对于为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入的专门借款，以专门借款当期实际发生的借款费用，减去尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额，来确定借款费用的资本化金额。

对于为购建或者生产符合资本化条件的资产而占用的一般借款，根据累计资产支出超过专门借款部分的资产支出加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。资本化率根据一般借款加权平均利率计算确定。

借款存在折价或者溢价的，按照实际利率法确定每一会计期间应摊销的折价或者溢价金额，调整每期利息金额。

## (十七) 无形资产核算方法

本公司无形资产主要包括交易席位费、软件等。

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。在非货币性资产交换具备商业实质且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无形资产以换出资产的公允价值为基础确定其入账价值，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无形资产的成本，不确认损益。

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。

每年度终了，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，本报告期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。

本公司购入的交易席位费按直线法在 10 年内进行摊销。

## (十八) 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。

本公司对商誉不摊销，商誉至少在每年年度终了进行减值测试。

## (十九) 买入返售与卖出回购证券业务

### 1、 买入返售证券业务

买入返售交易分为买断式或质押式，买断式是指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（包括债券和票据等），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。质押式是指作为质押权人，在交易对手将债券出质时，融出资金，质押到期日，以约定价格收回资金并返还出质债券。买入返售业务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。约定购回和质押回购融出资金业务其实质是为客户提供融资业务，参照质押式买入返售业务会计核算处理。

### 2、 卖出回购证券业务

卖出回购交易分为买断式或质押式，买断式是按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关资产（包括债券和票据）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。质押式是指将债券向交易对手出质时，获取资金，质押到期日，以约定价格支付资金并收回出质债券。卖出回购业务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示于资产负债表的相关科目内，并按照相关的会计政策核算。报价回购融入资金业务其实质是质押融资业务，

参照质押式卖出回购业务会计核算核算处理。

## (二十) 除金融资产、固定资产、在建工程外的其他主要资产的减值

长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、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。

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。

## (二十一) 职工薪酬

本公司在职工提供服务的会计期间，将应付的职工薪酬确认为负债，并根据职工提供服务的受益对象计入相关资产成本和费用。因解除与职工的劳动关系而给予的补偿，计入当期损益。

职工薪酬主要包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利、其他长期职工福利等与获得职工提供的服务相关的支出。

### 1、 短期薪酬的会计处理方法

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

本公司为职工缴纳的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，在职工为本公司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。



职工福利费为非货币性福利的，如能够可靠计量的，按照公允价值计量。

## 2、 离职后福利的会计处理方法

离职后福利是指本公司为获得职工提供的服务而在职工退休或与本公司解除劳动关系后，提供的各种形式的报酬和福利，属于短期薪酬和辞退福利的除外。本公司将离职后福利计划分类为设定提存计划和设定收益计划。

本公司按当地政府的相关规定为职工缴纳基本养老保险和失业保险，在职工为本公司提供服务的会计期间，按以当地规定的缴纳基数和比例计算应缴纳金额，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

除基本养老保险外，本公司还依据国家企业年金制度的相关政策建立了企业年金计划。本公司年金所需费用由企业和职工共同缴纳。本公司缴费按国家规定不超过本公司上年度员工工资总额的 1/12；公司和员工个人缴费合计不超过本公司上年度员工工资总额的 1/6。。

## 3、 辞退福利的会计处理方法

本公司在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，或确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时（两者孰早），确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益。

## (二十二) 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) 履行该义务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。

最佳估计数分别按以下情况处理：

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。

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。

## **(二十三) 股份支付及权益工具**

本公司的股份支付是为了获取职工或其他方提供服务而授予权益工具或者承担以权益工具为基础确定的负债的交易。本公司的股份支付分为以权益结算的股份支付和以现金结算的股份支付。

### **1、 以权益结算的股份支付及权益工具**

以权益结算的股份支付换取职工提供服务的，以授予职工权益工具的公允价值计量。本公司以限制性股票进行股份支付的，职工出资认购股票，股票在达到解锁条件并解锁前不得上市流通或转让；如果最终股权激励计划规定的解锁条件未能达到，则本公司按照事先约定的价格回购股票。本公司取得职工认购限制性股票支付的款项时，按照取得的认股款确认股本和资本公积（股本溢价），同时就回购义务全额确认一项负债并确认库存股。在等待期内每个资产负债表日，本公司根据最新取得的后续信息对可行权权益工具数量作出最佳估计，以此为基础，按照授予日的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用，相应增加资本公积。在可行权日之后不再对已确认的相关成本或费用和所有者权益总额进行调整。但授予后立即可行权的，在授予日按照公允价值计入相关成本或费用，相应增加资本公积。

对于最终未能行权的股份支付，不确认成本或费用，除非行权条件是市场条件或非可行权条件，此时无论是否满足市场条件或非可行权条件，只要满足所有可行权条件中的非市场条件，即视为可行权。

如果修改了以权益结算的股份支付的条款，至少按照未修改条款的情况确认取得的服务。此外，任何增加所授予权益工具公允价值的修改，或在修改日对职工有利的变更，均确认取得服务的增加。

如果取消了以权益结算的股份支付，则于取消日作为加速行权处理，立即确认尚未确认的金额。职工或其他方能够选择满足非可行权条件但在等待期内未满足的，作为取消以权益结算的股份支付处理。但是，如果授予新的权益工具，并在新权益工具授予日认定所授予的新权益工具是用于替代被取消的权益工具的，则以与处理原权益工具条款和条件修改相同的方式，对所授予的替代权益工具进行处理。

### **2、 以现金结算的股份支付及权益工具**

以现金结算的股份支付，按照本公司承担的以股份或其他权益工具为基础计算确定的负债

的公允价值计量。授予后立即可行权的，在授予日以承担负债的公允价值计入成本或费用，相应增加负债；完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的，在等待期内以对可行权情况的最佳估计为基础，按照承担负债的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用，增加相应负债。在相关负债结算前的每个资产负债表日以及结算日，对负债的公允价值重新计量，其变动计入当期损益。

#### (二十四) 利润分配

本公司当年实现的税后利润，在弥补以前年度亏损后，按 10%提取法定公积金，当法定公积金累计额为本公司注册资本 50%以上时，可不再提取。

根据《证券法》、财政部颁布实施的《金融企业财务规则》（财政部令第 42 号）文件和证监机构字【2007】320 号《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》文件的规定，本公司按税后利润的 10%提取一般风险准备金。

根据《金融企业财务规则—实施指南》（财金【2007】23 号）及中国证券监督委员会颁布实施的《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字【2007】320 号）文件，本公司按税后利润的 10%提取交易风险准备金；经股东大会决议，可以提取任意公积金；在弥补亏损和提取法定公积金、任意公积金、一般风险准备金和交易风险准备金后，按照股东大会批准的方案进行分配。

本公司提取的一般风险准备金和交易风险准备金，用于弥补证券交易的损失。公司的公积金用于弥补公司的亏损，扩大公司生产经营或者转为增加公司股本。法定公积金转为股本时，所留存的该项公积金不得少于转增前公司注册资本的 25%。

#### (二十五) 收入确认

交易已经发生并完成，相关的收入已收到或取得了收款的证据，且预计与交易相关的经济利益能够流入本公司，其相应的交易成本按权责发生制可以可靠地确认，即确定收入实现。

##### 1、 手续费收入

按中国证监会及沪、深交易所规定，于代理买卖证券交易日予以确认执行。

##### 2、 证券承销、保荐及财务顾问业务收入

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。发行保荐、财务顾问业务、投资咨询业务收入，于服务已经提供及收取金额可以合理估计时予以确认。

##### 3、 资产管理业务收入

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。

#### 4、 利息收入

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

买入返售金融资产在当期到期返售时，按返售价格与买入价格的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。

融资业务，按照融出资金金额确认债权，根据客户实际使用资金及使用时间，按每笔融资交易计算并确认相应的融资利息收入；

#### 5、 投资收益

本公司持有以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产期间取得的红息或现金股利确认为当期收益；处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产时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收益。

处置可供出售金融资产时，取得的价款与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额的和与该金融资产账面价值的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

#### 6、 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入。

### (二十六) 政府补助

#### 1、 类型

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。分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。

#### 2、 会计处理

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。

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。

## (二十七) 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。对于能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减，以很可能获得用来抵扣可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产。

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。

## (二十八) 经营租赁、融资租赁

### 1、 经营租赁会计处理

(1) 本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。本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本公司承担的与租赁相关的费用时，本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) 本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。本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。

本公司承担了应由承租方承担的与租赁相关的费用时，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。

### 2、 融资租赁会计处理

(1) 融资租入资产：本公司在承租开始日，将租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值两者中较低者作为租入资产的入账价值，将最低租赁付款额作为长期应付款的入账价值，其差额作为未确认的融资费用。本公司采用实际利率法对未确认的融资费用，在资产租赁期间内摊销，计入财务费用。本公司发生的初始直接费用，计入租入资产价值。

(2) 融资租出资产：本公司在租赁开始日，将应收融资租赁款，未担保余值之和与其现值的差额确认为未实现融资收益，在将来收到租金的各期间内确认为租赁收入。本公司发生的与出租交易相关的初始直接费用，计入应收融资租赁款的初始计量中，并减少租赁期内确认的收益金额。

### **(二十九) 融资融券业务核算办法**

融资融券业务是指向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动，具体可以分为融资业务和融券业务：

融资业务，按照融出资金金额确认债权，根据客户实际使用资金及使用时间，按每笔融资交易计算并确认相应的融资利息收入；

融券业务，在本公司融出证券时不做金融资产转移处理，根据客户实际卖出证券市值及使用时间，按每笔融券交易计算并确认相应的融券利息收入。

### **(三十) 代理发行证券核算办法**

(1) 对于以全额包销方式进行代理发行证券的业务，在按承购价格购入待发售证券时，确认一项资产，本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，按承销价格转为本公司的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产；

(2) 对于以余额包销方式进行代理发行证券的业务，本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本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) 对于代销方式进行代理发行证券的业务，本公司在收到代发行人发售的证券时，只在专设的备查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；

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

### **(三十一) 代兑付债券业务核算办法**

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

### **(三十二) 资产管理业务核算办法**



本公司开展的资产管理业务包括定向资产管理业务、集合资产管理业务和专项资产管理业务。为满足集合资产管理业务和专项资产管理业务信息披露要求，本公司参照基金管理公司对基金产品的财务核算和报表编制的要求，对本公司开展的集合资产管理业务和专项资产管理业务单独进行财务核算和编制财务报表。

### (三十三) 期货经纪业务核算办法

#### 3、 质押品的管理与核算方式

本公司只接受能实际控制的标准仓单为质押品，对进入交割期的仓单可冲抵部分保证金，并建立备查簿管理。对质押品的核算依据期货交易所的标准进行核算。

#### 4、 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。

### (三十四) 风险准备的计提

控股子公司南证期货经纪有限公司按照手续费及佣金净收入的 5% 提取交易损失准备金。提取的交易损失准备金计入“业务及管理费”科目核算。

### (三十五) 持有待售资产和终止经营

#### 1、持有待售资产确认标准

主要通过出售（包括具有商业实质的非货币性资产交换）而非持续使用一项非流动资产或处置组收回其账面价值的，本公司将其划分为持有待售类别。

非流动资产或处置组划分为持有待售类别，应同时满足下列条件：

- （1）根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；
- （2）出售极可能发生，即本公司已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求企业相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的，应当已经获得批准。

#### 2、持有待售类别的非流动资产或处置组的初始及后续计量

本公司按照《企业会计准则-固定资产》等相关规定计量首次划分为持有待售类别前的非流动资产或处置组中各项资产和负债的账面价值。

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

对于取得日划分为持有待售类别的非流动资产或处置组，本公司在初始计量时比较假定其不划分为持有待售类别情况下的初始计量金额和公允价值减去出售费用后的净额，以两者孰低计量。除

企业合并中取得的非流动资产或处置组外，由非流动资产或处置组以公允价值减去出售费用后的净额作为初始计量金额而产生的差额，应当计入当期损益。

本公司在资产负债表日重新计量持有待售的处置组时，首先按照相关规定计量处置组中不适用《企业会计准则-持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》（以下简称持有待售准则）计量规定的资产和负债的账面价值，然后按照持有待售准则规定进行会计处理。

对于持有待售的处置组确认的资产减值损失金额，本公司先抵减处置组中商誉的账面价值，再根据处置组中符合持有待售准则规定的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例抵减其账面价值。资产减值损失后续转回的，本公司根据处置组中除商誉外适用持有待售准则计量规定的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例增加其账面价值。

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

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

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

3、终止经营是满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已被本公司处置或被本公司划归为持有待售类别：

- （1）该组成部分代表一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区；
- （2）该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关联计划的一部分；
- （3）该组成部分是专为转售而取得的子公司。

### **(三十六) 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。

### **(三十七) 分部报告**

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。经营分部，是指本公司内同时满足下列条件的组成部分：

该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

本公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

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存在相似经济特征且同时在以下方面具有相同或相似性的，可以合并为一个经营分部：

- (1) 各单项产品或劳务的性质；
- (2) 生产过程的性质；
- (3) 产品或劳务的客户类型；
- (4) 销售产品或提供劳务的方式；
- (5) 生产产品及提供劳务受法律、行政法规的影响。

### **(三十八) 重要会计政策的确定依据以及会计估计中所采用的关键假设和不确定因素**

#### **1、 重要会计政策运用过程中所作的重要判断**

本公司重要会计政策的确定是依据财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和相关具体会计准则等配套文件，作为本公司财务报表的编制基础。详见本附注二。

##### **(1) 金融资产的分类**

本公司需在金融资产初始确认时根据管理层持有意图和金融资产的性质对金融资产进行分类，由于不同金融资产类别的后续计量方法存在很大差异，因此金融资产的分类对本公司的财务状况和经营成果将产生影响。

##### **(2) 合并范围的确定**

本公司对结构化主体是否控制及纳入合并范围作出重大判断，该项判断结果会影响会计核算方法及本公司的财务状况和经营成果。

本公司在评估控制时，需要考虑：1) 投资方对被投资方的权力；2) 参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；3) 有能力运用对被投资方的权力影响其回报的金额。

本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

- 1) 在设立被投资方时的决策及本集团的参与度；
- 2) 相关合同安排；
- 3) 仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；
- 4) 本集团对被投资方做出的承诺。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需考虑本公司的决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平、以及本公司因持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。

## 2、 会计估计所采用的关键假设和不确定因素

### (1) 金融资产和金融负债公允价值的确定方法

除存在活跃市场、且资产负债表日有成交市价的投资品种，本公司对下列证券均确定了估值方法，详见本附注三-(九)中“5、公允价值计量”。

A、对于虽存在活跃市场，但资产负债表日无成交市价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，本公司将指定专门部门在谨慎性原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定该投资品种的公允价值；

B、交易所发行未上市股票、债券和权证等；

C、交易所首次公开发行有明确锁定期的股票；

D、非公开发行有明确锁定期的股票；

E、对交易明显不活跃的、交易市价无法真实反映投资品种价值的或交易所停止交易的投资品种等。

### (2) 金融资产（不含应收款项）的减值

本公司对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，若有客观证据表明该金融资产发生减值的，则计提减值准备。其中权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回。

这些金融资产包括持有至到期投资和可供出售金融资产的减值准备。本公司对有减值迹象的持有至到期投资，根据预计现金流量的现值估计减值金额；对有减值迹象的可供出售金融资产，根据公允价值下降形成的累计损失估计减值金额。具体详见本附注三-(九)中“6、金融资产（不含应收款项）减值”。

### (3) 商誉的减值

本公司至少在每年年度终了测试商誉的减值。如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，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。具体详见本附注三-(二十)。

(4) 结算资金余额的坏账准备

结算资金往来包括应收及其他应收款项、融出资金等。本公司对结算资金往来，单独或按组合进行减值测试。根据预计未来的现金流量计算可收回金额，估计减值准备。对于融资融券业务形成的债权按照个别认定法和组合计提法计提坏账准备。具体详见本附注三-(十)。

#### 四、 主要会计政策和会计估计变更说明

##### (一) 主要会计政策变更

- 1、 本期本公司执行的《企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》  
财政部于 2017 年 4 月 28 日颁布财会【2017】13 号《财政部关于印发<企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营>的通知》文件，要求自 2017 年 5 月 28 日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行。

(1) 变更前本公司执行的持有待售的非流动资产、处置组和终止经营会计政策

本次会计政策变更前，本公司执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的财会【2016】3 号《财政部关于印发<企业会计准则第 1 号—存货>等 38 项具体准则的通知》、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关文件中涉及持有待售的非流动资产、处置组和终止经营相关规定。

(2) 持有待售的非流动资产、处置组和终止经营会计政策变更情况

本次会计政策变更后，本公司执行财政部于 2017 年 4 月 28 日颁布的《企业会计准则第 42 号—持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》相关规定，并于 2017 年 5 月 28 日采用未来适用法处理相关事项。变更后会计政策详见附注三-（三十五）。

(3) 本次会计政策变更对公司的影响

本次会计政策变更对公司未产生影响。

- 2、 本期本公司执行的《企业会计准则第 16 号—政府补助》

财政部于 2017 年 5 月 10 日颁布财会【2017】15 号《关于印发修订<企业会计准则第 16 号—政府补助>的通知》文件，并要求自 2017 年 6 月 12 日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行。

(1) 变更前公司执行的政府补助会计政策

本次会计政策变更前，本公司执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的财会【2016】3 号《财政部关于印发<企业会计准则第 1 号—存货>等 38 项具体准则的通知》中的《企业会计准则第 16 号—政府补助》、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定。

(2) 政府补助会计政策变更情况

根据财政部新修订的政府补助会计准则，与企业日常活动相关的政府补助，按照经济业务

实质计入其他收益或冲减相关成本费用，并在利润表中单独列报“其他收益”项目，列示计入其他收益的政府补助项目；与企业日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

该准则自 2017 年 6 月 12 日起在所有执行企业会计准则的企业范围内施行，并自 2017 年 1 月 1 日发生的政府补助采用未来适用法处理，对 2017 年 1 月 1 日至该准则施行日之间新增的政府补助根据该准则进行调整。

(3) 本次会计政策变更对公司的影响

项目	2017 年度
其他收益	2,390,000.00
营业外收入	-2,390,000.00

3、 本期本公司执行的财会【2017】30号《关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》

财政部于 2017 年 12 月 25 日发布了财会【2017】30 号《财政部关于修订印发一般企业财务报表格式的通知》文件，对一般企业财务报表格式进行了修订，对本公司报告期财务报表的影响情况如下：

(1) 报告期合并财务报表

会计政策变更的内容	受影响的合并报表项目		
	期间	名称	金额
(1) 在合并利润表中分别列示“持续经营净利润”和“终止经营净利润”。比较数据相应调整。	2016 年	持续经营净利润	493,719,756.21
	2017 年	持续经营净利润	412,211,555.24
(2) 在合并利润表中新增“资产处置收益”项目，将部分原列示为“营业外收入”的资产处置损益重分类至“资产处置收益”项目。比较数据相应调整。	2016 年	营业外收入	-7,298,177.10
		资产处置收益	7,298,177.10
	2017 年	营业外支出	-7,816.68
		营业外收入	-77,178.38
		资产处置收益	69,361.70

(2) 报告期财务报表

会计政策变更的内容	受影响的报表项目		
	期间	名称	金额
(1) 在利润表中分别列示“持续经营净利润”和“终止经营净利润”。比较数据相应调整。	2016 年	持续经营净利润	532,757,688.88
	2017 年	持续经营净利润	408,559,347.66
(2) 在利润表中新增“资产处置收益”项目，将部分原列示为“营业外收入”的资产处置损益重分类至“资产处置收益”项目。比较数据相应调整。	2016 年	营业外收入	-7,298,177.10
		资产处置收益	7,298,177.10
	2017 年	营业外支出	-7,726.17
		营业外收入	-51,472.41
		资产处置收益	43,746.24

(二) 重要会计估计变更

本期未发生会计估计变更。

五、 税项

(一) 主要适用税种及税率

税目	计税依据	税率
增值税	应纳税销售额乘以适用税率扣除当期允许抵扣的进项税后的余额	3%、5%、6%、17%
营业税	各项应税收入扣除相关费用后的净额	5%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税	5%、7%
教育费附加、地方教育费附加	实际缴纳的流转税	3%、2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、20%、15%

根据 2016 年 12 月 3 日财政部发布的《增值税会计处理规定》（财会【2016】22 号）的要求，本公司将“营业税金及附加”科目名称调整为“税金及附加”，该科目核算企业经营活动发生的消费税、城市维护建设税、资源税、教育费附加及房产税、土地使用税、车船税、印花税等相关税费。本公司自 2016 年 5 月 1 日起将原在管理费用中核算的房产税、土地使用税、车船税、印花税等调整至税金及附加项目核算及列报，同时将“应交税费”科目下的“待抵扣进项税额”、“待认证进项税额”、“未交增值税”期末借方余额重分至其他流动资产或者其他非流动资产科目列报。

(二) 增值税

- 1、 根据国务院令 第 362 号《中华人民共和国税收征收管理法实施细则》第三十八条和财税【2016】36 号《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日开始，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税，按照 3%、5%、6%、17% 的税率计算增值税销项税额，其中公司出租不动产适用简易征收销项税率为 5%，公司出售废旧物品销项税率为 17%，公司的小规模纳税人销项税率为 3%，除此之外的其他应税收入的增值税税率为 6%。
- 2、 根据国家税务总局公告 2014 年第 57 号《国家税务总局关于小微企业免征增值税和营业税有关问题的公告》，增值税小规模纳税人和营业税纳税人，月销售额或营业额不超过 3 万元（含 3 万元）的，自 2014 年 10 月 1 日起，免征增值税或营业税。
- 3、 根据财税【2016】36 号《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》过渡政策的规定，国债、地方政府债利息收入以及符合条件的统借统还利息收入免征增值税。
- 4、 根据财税【2016】46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》，金融机构开展质押式买入返售金融商品以及持有政策性金融债券取得的利息收入免征增值税。
- 5、 根据财税【2016】70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》，金融机构开展的同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、持有金融券后以及同业存单业务取得的利息收入免征增值税。
- 6、 根据财税【2016】36 号《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股



票、债券免征增值税。

### (三) 营业税

- 7、 根据财税【2001】21 号《财政部、国家税务总局关于降低金融、保险业营业税税率的通知》，从 2003 年起按营业收入的 5% 计缴。
- 3、 根据国税发【2002】9 号《金融保险业营业税申报管理办法》，金融机构往来利息收入不征收营业税。
- 4、 根据财税【2004】203 号《财政部、国家税务总局关于资本市场有关营业税政策的通知》，自 2005 年 1 月 1 日起，准许证券公司代收的经手费、过户费、监管费等从营业税计税营业额中扣除，按扣除后净额纳税；准许期货经纪公司为期货交易所代收的手续费从其营业税计税营业额中扣除。
- 5、 根据财税【2006】172 号《关于证券投资者保护基金有关营业税问题的通知》的规定，证券公司上缴的证券投资者保护基金从营业税计税营业额中扣除。
- 6、 根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税。
- 7、 根据国家税务总局公告 2013 年第 63 号《关于金融商品转让业务有关营业税问题的公告》，纳税人从事金融商品转让业务，不再按股票、债券、外汇、其他四大类来划分，统一归为“金融商品”，不同品种金融商品买卖出现的正负差，在同一纳税期内可以相抵，按盈亏相抵后的余额为营业额计算缴纳营业税。若相抵后仍出现负差的，可结转下一个纳税期相抵，但在年末仍出现负差的，不得转入下一个会计年度。
- 8、 根据财政部、国家税务总局财税字【2004】78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

### (四) 企业所得税

- 1、 本公司所得税的计算缴纳按照国家税务总局公告 2012 第 57 号《关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》执行。公司总部和各分支机构全面实行统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库的企业所得税征收办法。
- 2、 根据财政部、国家税务总局财税【2004】78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。
- 3、 根据财税【2017】23 号《财政部、税务总局关于证券行业准备金支出企业所得税税前扣除有关政策问题的通知》，本公司依据《证券结算风险基金管理办法》（证监发[2006]65 号）的有关规定，作为结算会员按人民币普通股和基金成交金额的十万分之三、国债现货成交金额的十万分之一、1 天期国债回购成交额的千万分之五、2 天期国债回购成交额的千万分

之十、3 天期国债回购成交额的千万分之十五、4 天期国债回购成交额的千万分之二十、7 天期国债回购成交额的千万分之五十、14 天期国债回购成交额的十万分之一、28 天期国债回购成交额的十万分之二、91 天期国债回购成交额的十万分之六、182 天期国债回购成交额的十万分之十二逐日缴纳的证券结算风险基金，准予在企业所得税税前扣除；依据《证券投资者保护基金管理办法》（证监会令第 27 号、第 124 号）的有关规定，按营业收入 0.5%—5%缴纳的证券投资者保护基金，准予在企业所得税税前扣除。本项规定自 2016 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止执行。

- 4、根据财税【2017】23 号《财政部、税务总局关于证券行业准备金支出企业所得税税前扣除有关政策问题的通知》，本公司控股子公司南证期货有限责任公司依据《期货公司管理办法》（证监会令第 43 号）和《商品期货交易财务管理暂行规定》（财商字〔1997〕44 号）的有关规定，从收取的交易手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5%提取的期货公司风险准备金，准予在企业所得税税前扣除；依据《期货投资者保障基金管理办法》（证监会令第 38 号、第 129 号）和《关于明确期货投资者保障基金缴纳比例有关事项的规定》（证监会财政部公告〔2016〕26 号）的有关规定，从收取的交易手续费中按照代理交易额的亿分之五至亿分之十的比例（2016 年 12 月 8 日前按千万分之五至千万分之十的比例）缴纳的期货投资者保障基金，在基金总额达到有关规定的额度内，准予在企业所得税税前扣除。本项规定自 2016 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止执行。
- 5、根据国家税务总局公告【2012】15 号《关于企业所得税应纳税所得额若干税务处理问题的公告》，从事代理服务、主营业务收入为手续费、佣金的企业（如证券、期货、保险代理等企业），其为取得该类收入而实际发生的营业成本（包括手续费及佣金支出），准予在企业所得税税前扣除。
- 6、根据财税【2011】76 号《财政部国家税务总局关于地方政府债券利息所得免征所得税问题的通知》，财税【2013】5 号《财政部国家税务总局关于地方政府债券利息免征所得税问题的通知》，企业取得的地方政府债券利息收入（所得）免征企业所得税。
- 7、根据财税【2011】58 号《财政部海关总署国家税务总局关于深入西部大开发战略有关税收政策问题的通知》文件，自 2011 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日，对设在西部地区的鼓励类产业企业减按 15%的税率征收企业所得税；根据银川市金凤区国家税务局《税务事项通知书》文件，公司控股子公司宁夏股权托管交易中心（有限公司）2017 年度享受减按 15% 税率征收企业所得税税收政策。
- 8、根据中华人民共和国主席令第六十三号《企业所得税法》第二十九条：民族自治地方的自治机关对本民族自治地方的企业应缴纳的企业所得税中属于地方分享的部分，可以决定减征或免征；根据银川市金凤区国家税务局《税务事项通知书》文件，公司控股子公司宁夏股权托管交易中心（有限公司）2017 年度享受应纳企业所得税中地方分享部分减免征收税收优惠政策。

- 9、 根据财税【2015】99号《财政部 国家税务总局关于进一步扩大小型微利企业所得税优惠政策范围的通知》和国家税务总局公告 2015 年第 61 号《关于贯彻落实进一步扩大小型微利企业减半征收企业所得税范围有关问题的公告》文件，自 2015 年 10 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日，对年应纳税所得额在 20 万元到 30 万元(含 30 万元)之间的小型微利企业，无论采取查账征收还是核定征收方式，其所得减按 50%计入应纳税所得额，按 20%的税率预缴或汇算清缴企业所得税。根据财税【2017】43 号《关于扩大小型微利企业所得税优惠政策范围的通知》文件，自 2017 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日，将小型微利企业的年应纳税所得额上限由 30 万元提高至 50 万元，对年应纳税所得额低于 50 万元(含 50 万元)的小型微利企业，其所得减按 50%计入应纳税所得额，按 20%的税率缴纳企业所得税。

(五) 其他税项：按国家和地方有关规定计算缴纳。

## 六、 合并财务报表主要项目注释（以下金额单位若未特别注明者均为人民币元）

### (一) 货币资金

#### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
现金	15,976.20	32,260.26
银行存款	6,234,329,418.43	8,830,100,510.67
其中：客户存款	5,652,875,221.68	7,623,024,609.24
公司存款	581,454,196.75	1,207,075,901.43
其他货币资金		
合计	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93

#### 2、 按照币种列示：

项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
库存现金			15,976.20
银行存款			6,234,329,418.43
其中：公司自有资金存款			572,233,455.21
公司信用资金存款			9,220,741.54
客户资金存款			5,004,366,851.03
其中：美元	10,614,468.39	6.53420	69,357,059.37
港元	19,956,958.19	0.83591	16,682,220.94
人民币			4,918,327,570.72
客户信用资金存款			648,508,370.65
其中：人民币			648,508,370.65
其他货币资金			
其中：新股申购款			
合计			6,234,345,394.63

项目	年初余额		
	原币	汇率	本币
库存现金			32,260.26
银行存款			8,830,100,510.67
其中：公司自有资金存款			1,195,490,365.81
公司信用资金存款			11,585,535.62
客户资金存款			6,800,087,614.87
其中：美元	11,884,694.28	6.93700	82,444,124.25
港元	18,711,905.94	0.89451	16,737,986.95
人民币			6,700,905,503.67
客户信用资金存款			822,936,994.37
其中：人民币			822,936,994.37
其他货币资金			
其中：新股申购款			
合计			8,830,132,770.93

3、 期末本公司货币资金余额中无抵押、质押、冻结等有限制流动及潜在回收风险的款项。

## (二) 结算备付金

### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
客户备付金	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
公司备付金	198,434,156.07	205,084,425.57
合计	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31

### 2、 按照币种列示：

项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
公司自有备付金			198,434,156.07
其中：人民币			198,434,156.07
公司信用备付金			
其中：人民币			
公司备付金合计			198,434,156.07
客户普通备付金			1,400,885,002.49
其中：美元	2,577,337.35	6.53420	16,840,837.71
港币	6,875,624.61	0.83591	5,747,403.37
人民币			1,378,296,761.41
客户信用备付金			303,170,460.30
其中：人民币			303,170,460.30
客户备付金合计			1,704,055,462.79
合计			1,902,489,618.86

项目	年初余额		
	原币	汇率	本币
公司自有备付金			205,084,425.57
其中：人民币			205,084,425.57
公司信用备付金			
其中：人民币			
公司备付金合计			205,084,425.57
客户普通备付金			1,707,651,213.80
其中：美元	2,269,431.18	6.93700	15,743,044.09
港币	9,374,210.88	0.89451	8,385,325.36
人民币			1,683,522,844.35
客户信用备付金			391,986,339.94
其中：人民币			391,986,339.94
客户备付金合计			2,099,637,553.74
合计			2,304,721,979.31

3、 期末本公司结算备付金余额中无抵押、质押、冻结等有限制流动及潜在回收风险的款项。

### (三) 融出资金

#### 1、 按照业务类别列示：

项目	期末余额	年初余额
融资融券业务融出资金	5,588,490,705.70	5,535,533,775.03
孖展融资		
减：减值准备	16,765,472.12	16,606,601.33
融出资金净值	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70

#### 2、 按照客户类别列示：

项目	期末余额	年初余额
个人	5,588,490,705.70	5,535,533,775.03
机构		
减：减值准备	16,765,472.12	16,606,601.33
融出资金净值	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70

#### 3、 按照账龄分析：

账龄	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	坏账准备	比例 (%)
1-3 个月	2,855,356,307.51	51.09	8,566,068.93	0.30
3-6 个月	1,219,962,249.26	21.83	3,659,886.75	0.30
6-12 个月	445,767,855.20	7.98	1,337,303.56	0.30
1 年以上	1,067,404,293.73	19.10	3,202,212.88	0.30
合计	5,588,490,705.70	100.00	16,765,472.12	

账龄	年初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	坏账准备	比例 (%)
1-3 个月	3,593,724,771.24	64.93	10,781,174.31	0.30
3-6 个月	673,744,432.57	12.17	2,021,233.30	0.30
6-12 个月	228,856,706.84	4.13	686,570.12	0.30
1 年以上	1,039,207,864.38	18.77	3,117,623.60	0.30
合计	5,535,533,775.03	100.00	16,606,601.33	

#### 4、 融资融券对应的担保物信息：

项目	期末余额	年初余额
货币资金	697,896,724.20	889,344,884.24
债券	7,965,566.81	1,124,762.29
基金	26,922,359.43	25,660,820.96
股票	16,217,892,876.12	16,977,020,083.53
合计	16,950,677,526.56	17,893,150,551.02

2017 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 558,853.15 万元，其中：融出资金余额 558,849.07 万元，融出证券余额 4.08 万元，担保物公允价值金额合计为 1,695,067.75 万元； 2016 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 553,560.10 万元，其中：融出资金余额 553,553.38 万元，融出证券余额 6.72 万元，担保物公允价值金额合计为 1,789,315.06 万元

#### 5、 期末融出资金逾期及其对应担保物金额：

截至 2016 年 12 月 31 日，本公司一位客户融出资金逾期平仓后未偿还，未偿还余额已转入应收款项并全额计提坏账准备。

截止 2017 年 12 月 31 日，本公司一位客户融出资金逾期平仓后未偿还，未偿还余额已转入应收款项并全额计提坏账准备。

#### 6、 本期本公司将上述融资融券业务中的部分债权收益权进行质押式回购，详见附注六-(二十一)。

### (四) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

#### 1、 按照明细列示：

项目	期末余额	
	账面价值	初始成本
为交易目的而持有的金融资产		
其中：股票	291,587,528.60	268,520,695.80
债券	1,659,300,465.65	1,716,398,616.90
基金	6,803,502.12	6,730,979.68
合计	1,957,691,496.37	1,991,650,292.38

项目	年初余额	
	账面价值	初始成本
为交易目的而持有的金融资产		
其中：股票	351,704,878.66	356,453,637.26
债券	1,843,656,681.55	1,904,038,681.22
基金	8,247,006.81	8,681,188.89
合计	2,203,608,567.02	2,269,173,507.37

**2、 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	期末余额	年初余额
正回购业务质押标的物	891,343,850.00	651,978,967.01
转融通拆入资金质押标的物		
合计	891,343,850.00	651,978,967.01

**3、 期末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。**

**(五) 衍生金融工具**

类别	期末余额					
	名义金额	套期工具		名义金额	非套期工具	
		资产	负债		资产	负债
股权类衍生工具				22,223,737.50		
其中：股指期货[注 1]				22,223,737.50		
权益互换						
利率衍生工具						
其中：利率互换						
其他衍生工具				124,453,715.00		1,051,600.00
其中：商品期货[注 2]				11,791,115.00		
商品期权[注 3]				112,662,600.00		1,051,600.00
合计				146,677,452.50		1,051,600.00

类别	年初余额					
	名义金额	套期工具		名义金额	非套期工具	
		资产	负债		资产	负债
股权类衍生工具				24,591,200.00		
其中：股指期货[注 1]				24,591,200.00		
利率衍生工具						
其中：利率互换						
合计				24,591,200.00		

注 1：

2017 年 12 月 31 月本公司持有的股指期货合约 18 手，其中：看跌合约 18 手，初始合约价值为 22,223,737.5 元，公允价值变动-5,702.50 元。



2016 年 12 月 31 日本公司持有的股指期货合约 24 手，其中：看跌合约 24 手，初始合约价值为 24,591,200.00 元，公允价值变动-222,080.00 元。

注 2:

2017 年 12 月 31 月本公司持有的商品期货合约 348 手，其中：看涨合约 79 手，初始合约价值为 3,433,595.00 元，公允价值变动-96,700.00 元；看跌合约 269 手，初始合约价值 8,357,520.00 元，公允价值变动 79,860.00 元

注 3:

2017 年 12 月 31 日本公司持有商品期权合约 4000 手，其中卖出商品期权合约 4000 手，收取期权费 1,227,435.18 元，公允价值变动 175,835.18 元。

由于股指期货采用当日无负债结算制度，股指期货业务结算备付金已包括本公司于 2017 年 12 月 31 日、2016 年 12 月 31 日所持有的股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融工具项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币 0 元。

## (六) 买入返售金融资产

### 1、按照标的物类别列示:

标的物类别	期末余额	年初余额
股票	2,284,062,941.08	880,256,800.00
债券	1,212,124,009.14	2,855,895,949.04
其中：国债	453,380,663.80	414,800,000.00
同业存单		
金融债	50,610,712.33	1,058,879,567.37
其他债	708,132,633.01	1,382,216,381.67
减：减值准备	6,852,188.82	2,640,770.40
合计	3,489,334,761.40	3,733,511,978.64

### 2、按照业务类别列示:

项目	期末余额	年初余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	2,284,062,941.08	880,256,800.00
其他债券回购业务	1,212,124,009.14	2,855,895,949.04
减：减值准备	6,852,188.82	2,640,770.40
合计	3,489,334,761.40	3,733,511,978.64

### 3、期末买入返售金融资产剩余期限

#### (1) 股票质押式回购剩余期限:

期限	期末余额	年初余额
1 个月内	144,693,128.76	14,280,000.00
1 个月至 3 个月内	371,589,933.88	190,500,000.00
3 个月至 1 年内	1,318,019,878.44	564,076,800.00

1 年以上	449,760,000.00	111,400,000.00
合计	2,284,062,941.08	880,256,800.00

(2) 其他债券回购业务融出资金剩余期限:

期限	期末余额	年初余额
1 个月内	1,212,124,009.14	2,608,580,255.90
1 个月至 3 个月内		197,091,220.54
3 个月至 1 年内		50,224,472.60
1 年以上		
合计	1,212,124,009.14	2,855,895,949.04

4、 担保物信息列示:

类别	期末余额	年初余额
股票	5,363,411,743.52	3,020,470,281.79
债券	1,220,603,893.80	2,872,468,876.50
合计	6,584,015,637.32	5,892,939,158.29

5、 期末买入返售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物，期末公允价值为 32,920.75 万元，质押到期日为 2018 年 1 月 2 日和 2018 年 1 月 4 日。

(七) 应收款项

1、 按照类别列示:

项目	期末余额	年初余额
资产管理产品管理费	5,394,027.94	3,561,737.61
融资业务客户资金	665,631.44	665,631.44
交易清算款	1,637.26	7,791.66
保荐、承销及财务顾问费	39,959.02	3,349,643.43
资产登记托管等业务	83,333.33	
其他业务	41,670.65	
减: 坏账准备	742,492.33	813,410.58
应收款项账面价值	5,483,767.31	6,771,393.56

2、 按照账龄列示:

账龄	期末余额		坏账准备
	金额	比例 (%)	
1 年以内	5,021,190.11	80.64	15,058.72
1-2 年	599,947.30	9.64	185,178.30
2-3 年	605,122.23	9.72	542,255.31
3 年以上			
合计	6,226,259.64	100.00	742,492.33

账龄	年初余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	5,748,523.32	75.79	155,897.78
1-2 年	1,836,280.82	24.21	657,512.80
2-3 年			
3 年以上			
合计	7,584,804.14	100.00	813,410.58

**3、按照评估方式列示:**

账龄	期末余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1、单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项			
2、按组合计提坏账准备的应收款项			
按账龄分析法计提坏账准备的应收款项	5,558,990.94	89.28	76,860.89
采用其他方法计提坏账准备的应收款项	1,637.26	0.03	
小计	5,560,628.20	89.31	76,860.89
3、单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项	665,631.44	10.69	665,631.44
合计	6,226,259.64	100.00	742,492.33

账龄	年初余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1、单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项			
2、按组合计提坏账准备的应收款项			
按账龄分析法计提坏账准备的应收款项	6,911,381.04	91.12	147,779.14
采用其他方法计提坏账准备的应收款项	7,791.66	0.10	
小计	6,919,172.70	91.22	147,779.14
3、单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项	665,631.44	8.78	665,631.44
合计	7,584,804.14	100.00	813,410.58

**4、组合中按账龄分析法计提坏账准备的应收款项:**

账龄	期末余额			
	金额	比例 (%)	坏账准备	坏账比例 (%)
1 年以内	5,019,552.79	90.30	15,058.66	0.30
1-2 年	460,854.44	8.29	46,085.44	10.00
2-3 年	78,583.71	1.41	15,716.79	20.00
3 年以上				
合计	5,558,990.94	100.00	76,860.89	

账龄	年初余额			
	金额	比例 (%)	坏账准备	坏账比例 (%)
1 年以内	5,601,638.80	81.05	16,804.92	0.30
1-2 年	1,309,742.24	18.95	130,974.22	10.00
2-3 年				
3 年以上				
合计	6,911,381.04	100.00	147,779.14	

**5、 组合中采用其他方法计提坏账准备的应收款项:**

项目	期末余额	
	账面余额	坏账准备
交易清算款	7,791.66	
合计	7,791.66	

项目	期初余额	
	账面余额	坏账准备
交易清算款	7,791.66	
合计	7,791.66	

**6、 单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项:**

项目	期末余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
融资业务客户款	665,631.44	665,631.44	100.00
合计	665,631.44	665,631.44	100.00

项目	年初余额		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
融资业务客户款	665,631.44	665,631.44	100.00
合计	665,631.44	665,631.44	100.00

**7、 坏账准备增减变动列示:**

项目	年初余额	本期计提	收回以前年度核销的坏账	本期减少		期末余额
				转回	转销	
坏账准备	813,410.58	-70,918.25				742,492.33
合计	813,410.58	-70,918.25				742,492.33

**8、 应收款项余额中前五名单位列示:**

单位名称	期末余额	账龄	占应收款项总额比例 (%)	款项性质
南京证券-无锡农商定向资产管理计划	1,632,686.71	1 年以内	26.22	资产管理费
南京证券-贵阳农商定向资产管理计划	1,103,227.09	1 年以内	17.72	资产管理费
两融业务客户	665,631.44	1-2 年, 2-3 年	10.69	逾期未偿还融出资金
南京证券-南京银行-温州银行定向资产管理计划	517,741.85	1 年以内、1-2 年, 2-3 年	8.32	资产管理费
南京证券-工商银行-江南农商定向资产管理计划	459,897.13	1 年以内	7.39	资产管理费
合计	4,379,184.22		70.34	

单位名称	年初余额	账龄	占应收款项总额比例 (%)	款项性质
江苏淮安农村商业银行股份有限公司	1,950,000.00	1 年以内	25.71	承销费
南京证券-贵阳农商行定向资产管理计划	1,179,263.17	1 年以内	15.55	资产管理费
恒立实业发展集团股份有限公司	848,000.00	1 年以内	11.18	财务顾问费
工商银行-江南农商行定向资产管理计划	837,453.39	1 年以内	11.04	资产管理费
两融业务客户	665,631.44	1 年以内、1-2 年	8.78	逾期未偿还融出资金
合计	5,480,348.00		72.25	

9、 期末无应收持有公司 5%（含 5%）以上股份的股东款项情况。

(八) 应收利息

1、 按照明细列示：

项目	期末余额	年初余额
存款利息	10,344,248.16	15,052,658.76
债券利息	77,985,707.57	85,709,895.10
债券逆回购业务利息	6,292,422.26	5,121,485.63
融资融券业务利息	80,183,377.87	67,050,226.74
股票质押式回购业务利息	2,807,127.70	6,832,451.78
减：坏账准备	4,000,000.00	4,000,000.00
合计	173,612,883.56	175,766,718.01

2、 其他说明：

报告期末（2016 年和 2017 年），本公司对逾期未收回的“15 云峰 PPN001”债券应收利息全额计提坏账准备 400 万元，具体详见附注十三-（三）。

(九) 存出保证金

项目	币种	期末余额		
		原币	汇率	本币
交易保证金	人民币			266,056,851.98
交易保证金	美元	270,000.00	6.53420	1,764,234.00
交易保证金	港元	1,000,000.00	0.83591	835,910.00
信用担保金	人民币			169.91
结算担保金	人民币			10,056,943.70
履约保证金	人民币			47,610,000.00
合计				326,324,109.59

项目	币种	年初余额		
		原币	汇率	本币
交易保证金	人民币			377,831,340.01
交易保证金	美元	270,000.00	6.93700	1,872,990.00
交易保证金	港元	1,000,000.00	0.89451	894,510.00
信用担保金	人民币			166.73

结算担保金	人民币			10,056,946.89
履约保证金	人民币			-
合计				390,655,953.63

(十) 可供出售金融资产

1、按照类别列示:

项目	期末余额		
	账面余额	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	1,933,098,890.76		1,933,098,890.76
可供出售权益工具	538,179,247.79		538,179,247.79
合计	2,471,278,138.55		2,471,278,138.55

项目	年初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	595,018,353.32		595,018,353.32
可供出售权益工具	1,905,739,909.80		1,905,739,909.80
合计	2,500,758,263.12		2,500,758,263.12

2、按照金融资产品种列示:

项目	期末余额			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
股票	13,889,701.77	9,248,861.76		23,138,563.53
债券	1,958,208,076.86	-25,109,186.10		1,933,098,890.76
基金	67,074,249.12	2,501,435.14		69,575,684.26
收益互换产品				
银行理财产品	346,465,000.00			346,465,000.00
其他权益投资[注]	99,000,000.00			99,000,000.00
合计	2,484,637,027.75	-13,358,889.20		2,471,278,138.55

项目	年初余额			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
股票	11,404,288.77	9,780,483.98		21,184,772.75
债券	574,343,410.74	20,674,942.58		595,018,353.32
基金	92,341,880.34	926,664.16		93,268,544.50
资产管理计划产品	10,005,800.00	70,040.60		10,075,840.60
收益互换产品	1,144,830,000.00	9,610,751.95		1,154,440,751.95
银行理财产品	527,770,000.00			527,770,000.00
其他权益投资[注]	99,000,000.00			99,000,000.00
合计	2,459,695,379.85	41,062,883.27		2,500,758,263.12

【注】权益工具系不具有控制、共同控制或重大影响的股权投资，明细列示如下：

被投资单位	持股比例 (%)	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
江苏股权交易中心	12.00	24,000,000.00			24,000,000.00
中证机构间报价系统股份有限公司	0.66	50,000,000.00			50,000,000.00
证通股份有限公司	0.99	25,000,000.00			25,000,000.00
合计		99,000,000.00			99,000,000.00

### 3、 报告期期末按公允价值计量的可供出售金融资产：

可供出售金融资产分类	期末余额		
	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/ 债务的摊余成本	427,428,950.89	1,958,208,076.86	2,385,637,027.75
公允价值	439,179,247.79	1,933,098,890.76	2,372,278,138.55
累计计入其他综合收益 的公允价值变动金额	11,750,296.90	-25,109,186.10	-13,358,889.20
已计提减值金额			

可供出售金融资产分类	年初余额		
	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/ 债务的摊余成本	1,786,351,969.11	574,343,410.74	2,360,695,379.85
公允价值	1,806,739,909.80	595,018,353.32	2,401,758,263.12
累计计入其他综合收益 的公允价值变动金额	20,387,940.69	20,674,942.58	41,062,883.27
已计提减值金额			

### 4、 融券业务开展情况：

项目	期末余额	年初余额
融出证券		
—可供出售金融资产	40,760.00	67,160.00
—转融通融入证券		
合计	40,760.00	67,160.00

本报告期融券业务无违约情况。

### 5、 融资融券担保物信息：

项目	期末余额	年初余额
货币资金	697,896,724.20	889,344,884.24
债券	7,965,566.81	1,124,762.29
基金	26,922,359.43	25,660,820.96
股票	16,217,892,876.12	16,977,020,083.53
合计	16,950,677,526.56	17,893,150,551.02

2017 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 558,853.15 万元，其中：融出资金余额 558,849.07 万元，融出证券余额 4.08 万元，担保物公允价值金额合计为 1,695,067.75 万元；2016 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 553,560.10 万元，其中：融出资金余额 553,553.38 万元，融出证券余额 6.72 万元，担保物公允价值金额合计为 1,789,315.06 万元。

6、 期末本公司未持有由本公司作为管理人的资产管理计划。

7、 期末本公司未持有限售条件可供出售金融资产。

8、 变现受到限制的可供出售金融资产：



项目	期末余额	年初余额
质押式正回购业务	1,097,880,784.61	482,043,517.70
买断式正回购业务	147,241,810.00	
转融通拆入资 金质押标的物		
融出证券	40,760.00	67,160.00
合计	1,245,163,354.61	482,110,677.70

9、 收益互换产品为本公司参与投资于中国证券金融股份有限公司专户。本公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险、分享投资收益。

10、 上述可供出售金融资产中无持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东作为发起人的金融资产。

### (十一) 长期股权投资

#### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
联营企业投资	242,574,996.31	97,581,710.02
其他长期投资		
合计	242,574,996.31	97,581,710.02
长期投资减值准备		
长期股权投资净值	242,574,996.31	97,581,710.02

#### 2、 联营企业投资明细：

被投资单位	核算方法	投资成本	年初余额	增减变动	期末余额
富安达基金管理 有限公司	权益法	251,370,000.00	97,581,710.02	117,962,142.91	215,543,852.93
南京东南巨石价 值成长股权投资 基金(有限合伙)	权益法	18,000,000.00		18,028,408.82	18,028,408.82
南京巨石高投股 权投资中心(有 限合伙)	权益法	9,000,000.00		9,002,734.56	9,002,734.56
合计		278,370,000.00	97,581,710.02	144,993,286.29	242,574,996.31

(续上表)

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
49.00	49.00				
18.00	18.00				
18.00	18.00				

3、 报告期内本公司对联营企业投资情况见附注八-（三）。

(十二) 固定资产

1、 账面价值列示:

项目	期末余额	年初余额
固定资产原值	1,273,945,983.22	553,923,187.04
减: 累计折旧	279,129,853.38	242,296,814.51
固定资产减值准备		
账面净值	994,816,129.84	311,626,372.53

2、 固定资产增减变动列示:

项目	房屋及建筑物	运输设备	电子设备及办公设备	合计
一、固定资产原值:				
年初余额	319,248,144.68	36,002,902.92	198,672,139.44	553,923,187.04
本期增加	691,809,941.01	816,193.86	57,221,224.37	749,847,359.24
其中: 在建工程转入	661,891,775.46		41,815,273.47	703,707,048.93
本期减少		573,225.00	29,251,338.06	29,824,563.06
期末余额	1,011,058,085.69	36,245,871.78	226,642,025.75	1,273,945,983.22
二、累计折旧:				
年初余额	121,254,413.55	33,142,014.31	87,900,386.65	242,296,814.51
本期计提	27,167,073.58	669,588.59	31,945,661.65	59,782,323.82
本期减少		556,028.25	22,393,256.70	22,949,284.95
期末余额	148,421,487.13	33,255,574.65	97,452,791.60	279,129,853.38
三、减值准备				
年初余额				
本期计提				
本期减少				
期末余额				
四、账面价值				
期末金额	862,636,598.56	2,990,297.13	129,189,234.15	994,816,129.84
年初金额	197,993,731.13	2,860,888.61	110,771,752.79	311,626,372.53

3、 期末本公司固定资产无抵押、质押、担保、置换等情况。

4、 期末本公司固定资产未出现减值迹象，未计提减值准备。

5、 本期增加的固定资产中无借款费用资本化金额。

6、 期末无通过融资租赁租入的固定资产。

7、 期末未办妥产权证书的固定资产情况:

项目	期末价值	未办妥产权证书的原因
北京千鹤家园 3 号 2503 室	956,347.46	根据 2009 年 9 月 17 日颁发的《北京市国土资源局关于原外销商品房土地登记有关问题的通知》，北京市只对 386 个“外销”商品房项目的购房人办理国有土地使用权证，如购房人申请办理上述“外销”商品房之外房屋的土地使用权证，土地主管部门
北京千鹤家园 3 号 2502 室	1,508,836.13	
北京千鹤家园 3 号 2501 室	1,018,817.27	

项目	期末价值	未办妥产权证书的原因
北京千鹤家园 3 号 2507 室	1,508,836.13	暂时不予受理。南京证券北京千鹤家园 3 号相关房产不在受理办证的“外销”商品房范围内，故截止 2017 年 12 月 31 日尚未办理土地使用权证。
北京千鹤家园 3 号 0401 室	1,021,098.14	
新办公大楼	651,595,830.51	正在办理中
停车位	23,373,394.28	正在办理中

### (十三) 在建工程

#### 1、 在建工程明细列示:

项目	期末余额			年初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
新办公大楼				648,318,365.22		648,318,365.22
其中：购房支出				563,551,020.00		563,551,020.00
装修支出				57,932,361.82		57,932,361.82
设备支出				26,834,983.40		26,834,983.40
合计				648,318,365.22		648,318,365.22

#### 2、 重大在建工程项目变动情况:

项目名称	预算/合同(含税, 亿元)	2016年12月31日	本期增加	转入其他长期资产	其他减少	2017年12月31日	工程投入占预算比例(%)	工程进度	利息资本化累计金额	其中：本期利息资本化金额	资金来源
新办公大楼	8.25	648,318,365.22	56,103,005.36	704,102,730.29	318,640.29		92.93			-	
其中：购房支出	5.64	563,551,020.00		563,232,379.71	318,640.29		100.00	已完工			自有资金
装修支出	2.61	57,932,361.82	35,848,603.67	93,780,965.49			77.84	已完工			自有资金
设备支出		26,834,983.40	20,254,401.69	47,089,385.09				已完工			自有资金

3、 2017 年在建工程其他减少发生额 318,640.29 元，主要系调整尚未支付的购房款。

4、 期末本公司在建工程未出现减值迹象，未计提减值准备。

5、 本期增加的在建工程中无借款费用资本化金额。

(十四) 无形资产

1、 按照类别列示:

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
无形资产原值				
交易席位费	4,312,067.70			4,312,067.70
软件	74,163,668.85	12,340,908.09		86,504,576.94
合计	78,475,736.55	12,340,908.09		90,816,644.64
累计摊销				
交易席位费	4,267,067.70	45,000.00		4,312,067.70
软件	40,454,317.33	15,725,644.82		56,179,962.15
合计	44,721,385.03	15,770,644.82		60,492,029.85
无形资产减值准备				
交易席位费				
软件				
合计				
无形资产账面价值				
交易席位费	45,000.00			
软件	33,709,351.52			30,324,614.79
合计	33,754,351.52			30,324,614.79

2、 无形资产中交易席位费:

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
无形资产原值				
上海证券交易所	2,512,067.70			2,512,067.70
深圳证券交易所	1,800,000.00			1,800,000.00
合计	4,312,067.70			4,312,067.70
累计摊销				
上海证券交易所	2,512,067.70			2,512,067.70
深圳证券交易所	1,755,000.00	45,000.00		1,800,000.00
合计	4,267,067.70	45,000.00		4,312,067.70
减值准备				
上海证券交易所				
深圳证券交易所				
合计				
无形资产净值				
上海证券交易所				
深圳证券交易所	45,000.00			
合计	45,000.00			

3、 期末本公司无形资产无抵押、质押、担保、置换等情况。

(十五) 商誉

1、 商誉账面原值列示:

被投资单位名称	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额	期末减值准备
南证期货有 限责任公司	5,845,161.39			5,845,161.39	

**2、 商誉形成过程：**

项目	南证期货有限责任公司
原始投资金额	41,850,000.00
购买日享有的被投资方可辨认净资产公允价值	36,004,838.61
非同一控制下合并商誉	5,845,161.39
减：已摊销	
减值准备	
已转销	
净额	5,845,161.39

**3、 期末未出现商誉可变现净值低于账面净值的情况，无需计提减值准备。**

**(十六) 递延所得税资产和递延所得税负债**

**1、 未经抵销的递延所得税资产：**

项目	期末余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
坏账准备	3,816,317.77	954,003.79
融出资金减值准备	16,765,472.12	4,191,368.03
买入返售金融资产减值准备	6,852,188.82	1,713,047.21
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产公允价值变动		
可供出售金融资产公允价值变动	13,358,889.20	3,339,722.31
可供出售金融资产减值准备		
衍生金融工具公允价值变动		
应付职工薪酬	127,493,943.90	31,873,485.98
预计负债	541,766.60	135,441.65
合计	168,828,578.41	42,207,068.97

项目	年初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
坏账准备	2,718,511.29	679,627.82
融出资金减值准备	16,606,601.33	4,151,650.33
买入返售金融资产减值准备	2,640,770.40	660,192.60
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产公允价值变动		
可供出售金融资产公允价值变动	251,539.34	62,884.84
可供出售金融资产减值准备		
衍生金融工具公允价值变动		
应付职工薪酬	176,590,420.94	44,147,605.24
预计负债	13,008,420.00	3,252,105.00
以公允价值计量且变动计入当期损益金融负债公允价值变动	1,239,510.00	309,877.50
合计	227,036,915.41	56,759,228.86

**2、 未经抵销的递延所得税负债：**

项目	期末余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产公允价值变动	20,089,250.13	5,022,312.53
可供出售金融资产公允价值变动		
衍生金融工具公允价值变动	158,995.18	39,748.80
固定资产折旧	8,162,134.53	2,040,533.63
合并报表未实现收益	851,345.98	212,836.50
合计	29,261,725.82	7,315,431.46

项目	年初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产公允价值变动		
可供出售金融资产公允价值变动	41,314,422.61	10,328,605.65
衍生金融工具公允价值变动	222,080.00	55,520.00
固定资产折旧	6,738,727.78	1,684,681.95
合并报表未实现收益	3,512,491.50	878,122.88
合计	51,787,721.89	12,946,930.48

**3、 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债：**

项目	期末余额	年初余额
递延所得税资产	42,207,068.97	56,759,228.86
递延所得税负债	7,315,431.46	12,946,930.48

**(十七) 其他资产**

**1、 按照类别列示：**

项目	期末余额	年初余额
其他应收款	7,661,468.63	15,265,454.22
预付账款	22,250,773.64	7,389,276.69
长期待摊费用	20,797,322.05	14,131,697.05
待摊费用	706,492.39	479,354.77
应收股利	31.80	24.95
期货会员资格	1,400,000.00	1,400,000.00
待抵扣增值税进项税额		401,380.40
待认证增值税进项税额		198,288.24
未交增值税	677,482.16	362,493.26
合计	53,493,570.67	39,627,969.58

**2、 其他应收款**

**(1) 按款项性质列示：**

性质	期末余额	年初余额
其他应收款余额	10,735,294.07	17,170,554.93
减：坏账准备	3,073,825.44	1,905,100.71
其他应收款账面价值	7,661,468.63	15,265,454.22



(2) 按照账龄披露列示:

账龄	期末余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	2,003,376.03	18.66	5,972.70
1-2 年	6,010,174.03	55.99	601,017.40
2-3 年	318,635.84	2.97	63,727.17
3 年以上	2,403,108.17	22.38	2,403,108.17
合计	10,735,294.07	100.00	3,073,825.44

账龄	年初余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1 年以内	14,219,725.80	82.82	23,119.60
1-2 年	334,601.22	1.95	33,460.13
2-3 年	965,483.66	5.62	197,776.73
3 年以上	1,650,744.25	9.61	1,650,744.25
合计	17,170,554.93	100.00	1,905,100.71

(3) 按照种类披露列示:

账龄	期末余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1、单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款			
2、按组合计提坏账准备的其他应收款			
按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款	10,722,816.65	99.88	3,073,825.44
采用其他方法计提坏账准备的其他应收款	12,477.42	0.12	
小计	10,735,294.07	100.00	3,073,825.44
3、单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款			
合计	10,735,294.07	100.00	3,073,825.44

账龄	年初余额		
	金额	比例 (%)	坏账准备
1、单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款			
2、按组合计提坏账准备的其他应收款			
按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款	10,657,362.79	62.07	1,905,100.71
采用其他方法计提坏账准备的其他应收款	6,513,192.14	37.93	-
小计	17,170,554.93	100.00	1,905,100.71
3、单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款			
合计	17,170,554.93	100.00	1,905,100.71

(4) 组合中按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款:

账龄	期末余额			
	金额	比例 (%)	坏账准备	坏账比例 (%)
1 年以内	1,990,898.61	18.57	5,972.70	0.30
1-2 年	6,010,174.03	56.05	601,017.40	10.00
2-3 年	318,635.84	2.97	63,727.17	20.00
3 年以上	2,403,108.17	22.41	2,403,108.17	100.00
合计	10,722,816.65	100.00	3,073,825.44	

账龄	年初余额			
	金额	比例 (%)	坏账准备	坏账比例 (%)
1 年以内	7,706,533.66	72.31	23,119.60	0.30
1-2 年	334,601.22	3.14	33,460.13	10.00
2-3 年	965,483.66	9.06	197,776.73	20.00
3 年以上	1,650,744.25	15.49	1,650,744.25	100.00
合计	10,657,362.79	100.00	1,905,100.71	

(5) 组合中, 采用其他方法计提坏账准备的其他应收款:

项目	期末余额		年初余额	
	账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
股票、债券申购款	12,477.42		6,513,192.14	

(6) 期末其他应收款主要单位明细:

名称	期末余额	占期末余额比例 (%)	款项性质	关联方关系
南通滨海园区控股发展有限公司	5,000,000.00	46.58	投标保证金	非关联方
投保基金待弥补已激活账户款	670,666.75	6.25	垫付款	非关联方
深圳市易尚北方大酒店有限公司	427,146.20	3.98	押金	非关联方
上海宏嘉房地产开发有限公司	417,100.02	3.89	押金	非关联方
深圳市投资控股有限公司	243,641.50	2.27	押金	非关联方
合计	6,758,554.47	62.97		

(7) 期末应收关联方以及持有公司 5% (含 5%) 以上股份的股东款项见附注九。

3、 预付账款

(1) 按照账龄列示:

项目	期末余额		年初余额	
	账面金额	比例 (%)	账面金额	比例 (%)
1 年以内	22,130,701.87	99.46	7,348,204.92	99.44
1-2 年	94,000.00	0.42	15,000.00	0.20
2-3 年			24,911.00	0.34
3 年以上	26,071.77	0.12	1,160.77	0.02
合计	22,250,773.64	100.00	7,389,276.69	100.00

(2) 期末预付账款前五名列示如下:

名称	期末余额	占期末余额比例 (%)	款项性质	关联方关系
东吴证券股份有限公司	5,283,018.86	23.74	保荐费	非关联方
立信会计师事务所	2,169,811.32	9.75	审计费	非关联方
国浩律师(上海)事务所	1,273,584.90	5.72	律师费	非关联方
张家港市商业大厦有限责任公司	1,104,285.71	4.96	预付房租款	非关联方

扬州嘉卉园林工程有 限公司	900,900.91	4.05	预付装修款	非关联方
合计	10,731,601.70	48.22		

**4、 长期待摊费用列示如下：**

项目	原始发生额	年初余额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	累计摊销/减 少	期末余额
装修费及其他	27,879,867.99	9,088,792.19	10,941,055.79	3,871,539.71		11,721,559.72	16,158,308.27
房屋使用权	6,254,578.10	5,042,904.86		403,891.08		1,615,564.32	4,639,013.78
合计	34,134,446.09	14,131,697.05	10,941,055.79	4,275,430.79		13,337,124.04	20,797,322.05

**5、 期货会员资格：**

项目	期末余额	年初余额
期货会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00
合计	1,400,000.00	1,400,000.00

**(十八) 资产减值准备**

项目	年初余额	本期计提	收回以前 年度核销 的坏账	本期减少		期末余额
				转回	转销	
坏账准备	6,718,511.29	1,097,806.48				7,816,317.77
可供出售金融 资产减值准备						-
买入返售金融 资产减值准备	2,640,770.40	4,211,418.42				6,852,188.82
融出资金减值 准备	16,606,601.33	158,870.79				16,765,472.12
长期股权投资 减值准备						
投资性房地产 减值准备						
固定资产减值 准备						
在建工程减值 准备						
无形资产减值 准备						
商誉减值准备						
合计	25,965,883.02	5,468,095.69				31,433,978.71

**(十九) 应付短期融资款**

**1、 按照类别列示：**

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
固定收益凭证		1,670,010,000.00	16,100,000.00	1,653,910,000.00
合计		1,670,010,000.00	16,100,000.00	1,653,910,000.00

**2、 短期固定收益凭证明细：**

名称	起息日	到期日	年利率（%）
快乐阳光 364 天 5 号 2 期	2017 年 4 月 13 日	2018 年 4 月 12 日	4.85
快乐阳光 365 天 5 号 3 期	2017 年 4 月 26 日	2018 年 4 月 26 日	4.60

快乐阳光 364 天收益凭证 5 号 4 期	2017 年 5 月 11 日	2018 年 5 月 10 日	4.90
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 5 期	2017 年 5 月 16 日	2018 年 5 月 16 日	4.90
快乐阳光 363 天收益凭证 5 号 6 期	2017 年 5 月 19 日	2018 年 5 月 17 日	5.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 7 期	2017 年 5 月 23 日	2018 年 5 月 23 日	5.00
快乐阳光 280 天收益凭证 4 号 2 期	2017 年 5 月 24 日	2018 年 2 月 27 日	4.90
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 8 期	2017 年 6 月 13 日	2018 年 6 月 13 日	5.30
快乐阳光 180 天收益凭证 1 号 15 期	2017 年 8 月 17 日	2018 年 2 月 13 日	5.10
鑫享 1 号 1 期 14 天固定收益凭证	2017 年 9 月 27 日	2017 年 10 月 11 日	6.66
鑫享 1 号 2 期 14 天固定收益凭证	2017 年 9 月 29 日	2017 年 10 月 13 日	6.66
鑫享 1 号 3 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 11 日	2017 年 10 月 25 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 3 期	2017 年 10 月 12 日	2018 年 1 月 10 日	5.00
鑫享 1 号 4 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 13 日	2017 年 10 月 27 日	6.66
鑫享 1 号 5 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 18 日	2017 年 11 月 1 日	6.66
鑫享 1 号 6 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 25 日	2017 年 11 月 8 日	6.66
鑫享 1 号 7 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 1 日	2017 年 11 月 15 日	6.66
鑫享 1 号 8 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 8 日	2017 年 11 月 22 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 4 期	2017 年 11 月 9 日	2018 年 2 月 7 日	5.10
鑫享 1 号 9 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 15 日	2017 年 11 月 29 日	6.66
鑫享 1 号 10 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 22 日	2017 年 12 月 6 日	6.66
鑫享 1 号 11 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 29 日	2017 年 12 月 13 日	6.66
鑫享 1 号 12 期 14 天固定收益凭证	2017 年 12 月 6 日	2017 年 12 月 20 日	6.66
鑫享 1 号 13 期 14 天固定收益凭证	2017 年 12 月 13 日	2017 年 12 月 27 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 5 期	2017 年 12 月 14 日	2018 年 3 月 14 日	5.15

(续上表)

名称	年初余额	本期发行	本期偿还	期末余额
快乐阳光 364 天 5 号 2 期 SP5827		500,000,000.00		500,000,000.00
快乐阳光 365 天 5 号 3 期 SQ1788		59,270,000.00		59,270,000.00
快乐阳光 364 天收益凭证 5 号 4 期		46,950,000.00		46,950,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 5 期		39,910,000.00		39,910,000.00
快乐阳光 363 天收益凭证 5 号 6 期		37,060,000.00		37,060,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 7 期		26,040,000.00		26,040,000.00
快乐阳光 280 天收益凭证 4 号 2 期		300,000,000.00		300,000,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 8 期		300,000,000.00		300,000,000.00
快乐阳光 180 天收益凭证 1 号 15 期		300,000,000.00		300,000,000.00
鑫享 1 号 1 期 14 天固定收益凭证		1,200,000.00	1,200,000.00	-
鑫享 1 号 2 期 14 天固定收益凭证		1,900,000.00	1,900,000.00	-
鑫享 1 号 3 期 14 天固定收益凭证		1,750,000.00	1,750,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 3 期		15,450,000.00	-	15,450,000.00
鑫享 1 号 4 期 14 天固定收益凭证		2,250,000.00	2,250,000.00	-
鑫享 1 号 5 期 14 天固定收益凭证		1,100,000.00	1,100,000.00	-
鑫享 1 号 6 期 14 天固定收益凭证		900,000.00	900,000.00	-
鑫享 1 号 7 期 14 天固定收益凭证		950,000.00	950,000.00	-
鑫享 1 号 8 期 14 天固定收益凭证		1,050,000.00	1,050,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 4 期		20,000,000.00	-	20,000,000.00
鑫享 1 号 9 期 14 天固定收益凭证		850,000.00	850,000.00	-
鑫享 1 号 10 期 14 天固定收益凭证		1,450,000.00	1,450,000.00	-

鑫享 1 号 11 期 14 天固定收益凭证		1,050,000.00	1,050,000.00	-
鑫享 1 号 12 期 14 天固定收益凭证		750,000.00	750,000.00	-
鑫享 1 号 13 期 14 天固定收益凭证		900,000.00	900,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 5 期		9,230,000.00	-	9,230,000.00
合计		1,670,010,000.00	16,100,000.00	1,653,910,000.00

- 3、 根据中国证券业协会发布的《证券公司柜台市场管理办法（试行）》及《机构间私募产品报价与服务系统管理办法（试行）》的通知（中证协发【2014】137 号），本公司于 2014 年 9 月开始发行收益凭证。

(二十) 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	年初余额
交易性金融负债		57,720,060.00
合计		57,720,060.00

(二十一) 卖出回购金融资产款

1、 按金融资产类别列示：

项目	期末余额	年初余额
债券	2,359,381,144.71	2,621,608,266.12
融资融券收益权	500,000,000.00	-
质押式报价回购		
合计	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12

2、 按照标的物类别列示：

项目	期末余额	年初余额
国债	300,000,000.00	160,956,000.00
金融债		765,112,320.84
同业存单	802,358,391.29	
短期融资券	99,000,000.00	220,138,767.12
中期票据	405,381,260.27	594,781,967.21
公司债	752,641,493.15	880,619,210.95
融资融券收益权	500,000,000.00	
合计	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12

3、 按照业务类别列示：

项目	期末余额	年初余额
债券质押式回购	1,709,530,000.00	1,445,261,000.00
债券买断式回购	649,851,144.71	1,176,347,266.12
融资融券收益权转让借款	500,000,000.00	
合计	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12

**4、 质押式回购融入资金按照剩余期限列示:**

期限	期末余额	利率区间 (%)	年初余额	利率区间 (%)
1 个月内	1,709,530,000.00	4.50-20.00	1,445,261,000.00	2.00-6.00
1 个月至 3 个月内				
合计	1,709,530,000.00		1,445,261,000.00	

**5、 买断式回购融入资金按照剩余期限列示:**

期限	期末余额	利率区间 (%)	年初余额	利率区间 (%)
1 个月内	649,851,144.71	4.00-11.00	979,256,045.58	2.50-5.10
1 个月至 3 个月内			197,091,220.54	4.50
合计	649,851,144.71		1,176,347,266.12	

**6、 卖出回购金融资产款担保物信息列示:**

项目	标的物类别	期末余额	年初余额
债券质押式回购	债券	1,799,811,084.61	1,561,969,164.15
债券买断式回购	债券	665,862,840.00	1,160,643,510.00
融资融券收益权转让借款	融资融券收益权	545,772,214.57	
合计		3,011,446,139.18	2,722,612,674.15

**(二十二) 代理买卖证券款**

**1、 代理买卖证券款按客户类别列示:**

项目	期末余额	年初余额
普通经纪业务:	6,403,717,119.38	8,535,301,250.91
个人客户	5,978,837,192.86	7,907,332,400.37
机构客户	424,879,926.52	627,968,850.54
信用业务:	648,508,370.66	822,936,994.37
个人客户	648,508,370.66	822,936,994.37
机构客户		
合计	7,052,225,490.04	9,358,238,245.28
个人客户	6,627,345,563.52	8,730,269,394.74
机构客户	424,879,926.52	627,968,850.54

**2、 代理买卖证券款按币种类别列示:**

项目	期末余额		
	原币	汇率	(折)人民币
人民币			6,970,928,225.00
美元	9,876,377.72	6.53420	64,534,227.28
港币	20,053,639.44	0.83591	16,763,037.76
合计			7,052,225,490.04

项目	年初余额		
	原币	汇率	(折)人民币
人民币			9,263,343,079.61
美元	10,909,396.18	6.93700	75,678,481.32
港币	21,482,917.29	0.89451	19,216,684.35
合计			9,358,238,245.28

**(二十三) 代理承销证券款**

项目	期末余额	年初余额
代理承销基金款	953,688.33	108,297.15
代理承销企业债券款		
合计	953,688.33	108,297.15

**(二十四) 应付职工薪酬**

**1、 应付职工薪酬列示:**

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期薪酬	194,212,697.74	459,155,755.99	510,307,944.13	143,060,509.60
离职后福利-设定提存计划	14,843,941.63	62,027,392.43	58,694,506.51	18,176,827.55
辞退福利				
一年内到期的其他福利				
合计	209,056,639.37	521,183,148.42	569,002,450.64	161,237,337.15

**2、 短期薪酬列示:**

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
工资、奖金、津贴和补贴	186,572,750.02	368,541,363.70	421,023,831.87	134,090,281.85
职工福利费		20,154,893.58	20,154,893.58	
社会保险费	23,584.39	22,373,085.26	22,336,442.87	60,226.78
其中: 医疗保险费	21,370.39	20,133,603.99	20,096,252.13	58,722.25
工伤及生育保险费	2,214.00	2,239,481.27	2,240,190.74	1,504.53
住房公积金	7,973.16	27,570,021.21	27,575,243.37	2,751.00
工会经费	7,608,390.07	4,598,066.01	3,299,206.21	8,907,249.87
职工教育经费	0.10	2,867,502.23	2,867,502.23	0.10
住房补贴		13,050,824.00	13,050,824.00	
非货币性福利				
因解除劳动关系给予的补偿				
合计	194,212,697.74	459,155,755.99	510,307,944.13	143,060,509.60

**3、 设定提存计划列示:**

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
基本养老保险	51,565.79	42,796,687.94	42,739,297.98	108,955.75
失业保险费	1,558.82	1,172,059.99	1,171,993.47	1,625.34
企业年金缴费	14,790,817.02	18,058,644.50	14,783,215.06	18,066,246.46
合计	14,843,941.63	62,027,392.43	58,694,506.51	18,176,827.55

**4、 报告期本公司发放的高级管理人员薪酬:**

单位: 万元

项目	本期数	上期数
高级管理人员薪酬	401.12	666.91



(二十五) 应交税费

项目	期末余额	年初余额
所得税	30,340,160.27	78,501,257.96
营业税	195,287.67	157,787.67
城建税	901,025.67	1,085,847.65
教育费附加	642,835.09	774,542.67
个人所得税	28,294,099.61	7,121,252.81
代扣代交利息税	4,860,372.91	4,159,495.84
投资者保护基金	8,034,064.55	8,494,783.79
增值税	10,561,729.25	7,060,114.72
其他	229,611.78	313,747.48
合计	84,059,186.80	107,668,830.59

(二十六) 应付款项

1、 按照类别列示:

项目	期末余额	年初余额
清算款	5,240,271.05	3,565,963.39
代理业务款	1,458,428.83	1,415,684.63
期货投资者保障基金	31,283.80	67,821.80
结构化主体管理人等报酬	280,259.45	380,054.26
经纪手续费	23,710.76	1,972,345.29
设备物资款		
合计	7,033,953.89	7,401,869.37

2、 应付款项期末余额前五名单位列示:

单位名称/款项类别	期末余额	款项性质
清算款	5,240,271.05	未登记待支付红利
代理业务款	1,458,428.83	代理业务款
北京国际信托有限公司	130,890.76	信托管理费
富安达基金管理有限公司	74,688.76	管理人报酬
中国邮政储蓄银行股份有限公司	43,629.95	信托托管费
合计	6,947,909.35	

(二十七) 应付利息

项目	期末余额	年初余额
客户资金存款利息	584,839.89	818,247.72
次级债券利息	4,783,013.69	114,626,805.85
固定收益凭证利息	47,828,042.91	0.38
非公开发行公司债利息		39,000,000.00
公开发行公司债利息	9,225,205.47	
两融收益权转让利息	825,000.00	
债券回购利息	2,674,193.48	2,988,498.21
其他利息	385,720.54	750,000.00
合计	66,306,015.98	158,183,552.16

## (二十八) 预计负债

### 1、 按照类别列示:

项目	期末余额	年初余额
未决诉讼	541,766.60	13,008,420.00
合计	541,766.60	13,008,420.00

### 2、 报告期发生的诉讼事项说明:

报告期发生的诉讼事项详见附注十。

## (二十九) 应付债券

### 1、 应付债券明细:

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
次级债	3,000,000,000.00		2,300,000,000.00	700,000,000.00
非公开发行公司债第一期	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	-
公开发行公司债券		997,179,834.23		997,179,834.23
合计	4,200,000,000.00	997,179,834.23	3,500,000,000.00	1,697,179,834.23

### 2、 应付债券-次级债明细列示:

债券名称	面值	起息日	债券期限	发行金额	年初余额	本期发行
14 南京债	100	2014 年 11 月 19 日	4 年	700,000,000.00	700,000,000.00	
15 南京 02	100	2015 年 4 月 17 日	2 年	1,300,000,000.00	1,300,000,000.00	
15 南京 01	100	2015 年 3 月 3 日	2 年	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	
合计					3,000,000,000.00	

(续上表)

债券名称	溢折价摊销	本期偿还	期末余额
14 南京债			700,000,000.00
15 南京 02		1,300,000,000.00	
15 南京 01		1,000,000,000.00	
合计		2,300,000,000.00	700,000,000.00

根据第一届董事会第六次会议，并经 2012 年度股东大会会议批准，本公司发行次级债券累计总额不超过 30 亿元。

2014 年本公司发行次级债 7 亿元，采用固定利率形式，票面年利率为 5.80%，并在债券存续期内的前 2 年固定不变。本期债券存续期限的第 2 年末，公司可选择调整票面利率 0 至 100 个基点（含本数），债券票面年利率为债券存续期前 2 年票面年利率加上公司上调的基点，在债券存续期后 2 年固定不变。

2015 年本公司发行 2015 年次级债券（第一期）（简称：15 南京 01）和 2015 年次级债（第二期）（简称：15 南京 02），发行规模分别为 10 亿元和 13 亿元，采用固定利率形式，年利率分别为 5.90%和 6.05%。

### 3、 非公开公司债明细列示:

债券名称	面值	起息日	到期日	发行金额
非公开发行公司债第一期	100	2015 年 6 月 26 日	2017 年 6 月 25 日	1,200,000,000.00
合计	100			1,200,000,000.00

(续上表)

债券名称	按面值计提利息	年初余额	溢折价摊销	本期偿还	期末余额
非公开发行公司债第一期	73,200,000.00	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	
合计	73,200,000.00	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	

根据深圳证券交易所《关于南京证券股份有限公司 2015 年非公开发行公司债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函【2015】284 号), 公司获准非公开发行面值不超过 40 亿元人民币的公司债券。本期发行债券采用固定利率形式, 票面利率 6.00%。

#### 4、 公开发行公司债明细列示:

债券名称	面值	起息日	到期日	发行金额	初始摊余成本
应付公司债券 (17 南京 01)	100	2017/10/24	2020/10/23、 2022/10/23	1,000,000,000.00	997,000,000.00
合计	100			1,000,000,000.00	997,000,000.00

(续上表)

债券名称	按面值计提利息	年初余额	溢折价等摊销	本期偿还	期末余额
应付公司债券 (17 南京 01)	9,225,205.48		179,834.23		997,179,834.23
合计	9,225,205.48		179,834.23	-	997,179,834.23

根据中国证监会《关于核准南京证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可【2016】2850 号) 和上海证券交易所《关于南京证券股份有限公司面向合格投资者公开发行公司债券上市预审核意见的函》(上证债(审)【2016】370 号), 公司获准面向合格投资者公开发行面值不超过 36 亿元人民币公司债券。2017 年公司发行债券票面总额 10 亿元, 采用固定利率形式, 票面利率 4.88%, 发行费用 300 万元, 实际利率 4.99%。本期债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止, 若投资者行使回售权, 则计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2020 年 10 月 23 日止, 未回售部分债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止。

- 5、 根据中国证券业协会发布的《证券公司柜台市场管理办法(试行)》及《机构间私募产品报价与服务系统管理办法(试行)》的通知(中证协发【2014】137 号), 本公司于 2014 年 9 月开始发行收益凭证。

(三十) 其他负债

1、 其他负债构成明细:

项目	期末余额	年初余额
代兑付债券款	3,496,725.21	3,517,527.77
应付股利	22,459,022.61	75,980,479.71
其他应付款	118,605,821.07	73,730,405.83
预收账款	4,349,112.66	5,564,444.44
期货风险准备金	19,857,034.73	18,346,080.40
待兑付债券款	366,586.00	366,586.00
纳入合并范围结构化主体其他收益人款	340,962,429.35	654,878,650.59
合计	510,096,731.63	832,384,174.74

2、 代兑付债券款本期变化情况:

项目	年初余额	本期收到 兑付资金	本期已兑付 债券	本期结转 手续费收入	期末余额
企业债券	3,517,527.77		20,802.56		3,496,725.21
合计	3,517,527.77		20,802.56		3,496,725.21

3、 其他应付款

(1) 期末其他应付款前五名列示:

项目	期末余额	款项性质
南京金融城建设发展股份有限公司	62,115,255.16	新办公大楼款、车位款等
北京捷通机房设备工程有限公司	7,860,066.27	工程款
南京华典建筑装饰工程有限公司	7,784,967.51	装修款
深圳市深装总装饰工程工业有限公司	5,989,216.89	装修款
广东世纪达装饰工程有限公司	5,933,702.03	装修款
合计	89,683,207.86	

(2) 期末余额中无欠持公司 5%以上（含 5%）表决权股份的股东单位款项。

4、 预收账款

(1) 期末预收账款按照性质列示:

项目	期末余额	年初余额
房租款	548,839.71	
登记托管等服务费	2,748,049.67	5,564,444.44
财务顾问费	971,839.22	
其他	80,384.06	
合计	4,349,112.66	5,564,444.44

(2) 期末账龄超过一年的重要预收账款:

项目	期末余额	未偿还或结转的原因
登记托管服务费	2,031,571.78	按照服务期限分期确认收入
合计	2,031,571.78	

(3) 期末主要客户预收账款:

项目	期末余额	性质
中植资本管理有限公司	2,074,339.56	登记托管服务费
紫金信托有限责任公司	943,537.34	财务顾问费
宁夏吉元冶金集团有限公司	215,376.78	登记托管服务费
合计	3,233,253.68	

5、 应付股利

项目	期末余额	年初余额
公司股东股利	22,459,022.61	75,980,479.71
子公司少数股东股利		
合计	22,459,022.61	75,980,479.71

6、 待兑付债券款

项目	期末余额	年初余额
待兑付债券	366,586.00	366,586.00
合计	366,586.00	366,586.00

7、 期末期货风险准备金余额系本公司控股子公司南证期货有限责任公司根据中国证券监督管理委员会的规定按手续费及佣金净收入的 5%提取;

8、 根据中国证券监督管理委员会公告 2010 年 7 号文关于期货交易所、期货公司缴纳期货投资者保障基金有关事项的规定, 由期货交易所按期货公司代理交易额的千万分之十代扣代缴期货公司应缴纳的保障基金。本公司子公司南证期货有限责任公司在 2010 年 9 月份开始按代理交易额的千万分之八缴纳, 2016 年 9 月至 11 月份按照代理交易额的千万分之七缴纳, 2016 年 12 月至 2017 年 12 月按照代理交易额的亿分之七缴纳, 期末应付期货投资者保障基金余额为按上述要求已计提尚未缴纳的款项。

(三十一) 股本

1、 本期股份变动情况:

项目	年初余额	本期变动增 (+) 减 (-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	合计	
股份总额	2,473,999,503.00						2,473,999,503.00

2、 报告期末股份质押情况:

截至 2017 年 12 月 31 日, 本公司股东山东泰祥房地产开发有限公司所持有的本公司 27,339,425 股股份已被冻结; 本公司股东南京三宝数码科技有限公司所持有的本公司 24,232,922 股股份已被质押; 本公司股东江苏金涛投资控股有限公司所持有的本公司 23,660,867 股股份已被质押; 本公司股东南京钢铁集团有限公司所持有的本公司 41,900,000 股股份已被质押; 本公司股东上海新龙基(集团)有限公司所持有的本公司 16,666,667 股

股份已被质押。

## (三十二) 资本公积

### 1、 按照明细列示：

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1. 资本溢价（股本溢价）				
(1)投资者投入的资本	4,089,218,143.16			4,089,218,143.16
(2)与少数股东的权益性交易	-16,769,158.27			-16,769,158.27
小计	4,072,448,984.89			4,072,448,984.89
2. 其他资本公积				
合计	4,072,448,984.89			4,072,448,984.89

### 2、 报告期内增减变动情况：

无。

(三十三) 其他综合收益

项 目	年初余额	本期数					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	
1. 以后不能重分类进损益的其他综合收益							
其中：(1)重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动							
(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							
2. 以后将重分类进损益的其他综合收益	34,231,524.41	-38,156,260.02	20,048,694.83	-13,605,443.13	-44,599,511.72		-10,367,987.31
其中：(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	3,434,361.96	-3,783,182.38			-3,783,182.38		-348,820.42
(2)可供出售金融资产公允价值变动损益	30,797,162.45	-34,373,077.64	20,048,694.83	-13,605,443.13	-40,816,329.34		-10,019,166.89
(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							
其他综合收益合计	34,231,524.41	-38,156,260.02	20,048,694.83	-13,605,443.13	-44,599,511.72	-	-10,367,987.31



#### (三十四) 盈余公积

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	284,765,719.16	40,855,934.77		325,621,653.93
任意盈余公积				
合计	284,765,719.16	40,855,934.77		325,621,653.93

报告期本公司计提的盈余公积为根据《金融企业财务规则》的要求，并根据中国证监会证监机构字【2007】第 320 号文的通知，公司按照当期实现净利润的 10%提取法定盈余公积金，用于弥补本公司的亏损、扩大本公司生产经营或者转为增加股本。

#### (三十五) 一般风险准备

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备	604,643,341.05	41,681,365.85		646,324,706.90
交易风险准备	572,526,787.27	40,855,934.77		613,382,722.04
合计	1,177,170,128.32	82,537,300.62		1,259,707,428.94

报告期本公司计提的一般风险准备为根据《金融企业财务规则》的要求，并根据中国证监会证监机构字【2007】第 320 号文的通知，公司按照当期实现净利润的 10%提取一般风险准备金，用于弥补尚未识别的可能性损失。

报告期本公司计提的交易风险准备为根据《金融企业财务规则》的要求，并根据中国证监会证监机构字【2007】第 320 号文的通知，公司按照当期实现净利润的 10%提取交易风险准备金，用于弥补证券交易的损失。

报告期本公司计提的一般风险准备还包括本公司下属子公司南证期货有限责任公司根据行业或者所属地区适用法规提取的一般风险准备和交易风险准备中归属于母公司所有者的份额。

#### (三十六) 未分配利润

项目	本期数	上期数
年初未分配利润	1,205,414,032.52	1,243,710,626.47
加：归属于母公司所有者的净利润	410,602,756.36	493,557,293.51
减：提取法定盈余公积	40,855,934.77	53,275,768.89
提取一般风险准备	41,681,365.85	54,202,424.23
提取交易风险准备金	40,855,934.77	53,275,768.89
对股东的分配	247,399,950.30	371,099,925.45
转增股本		
期末未分配利润	1,245,223,603.19	1,205,414,032.52

#### (三十七) 少数股东权益

子公司名称	期末余额	年初余额
宁夏股权托管交易中心（有限公司）	30,916,232.38	29,303,758.51
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	2,705,345.98	2,709,020.97
合计	33,621,578.36	32,012,779.48

(三十八) 手续费及佣金净收入

1、 按照类别列示:

项目	本期数	上期数
<b>手续费及佣金收入</b>		
<b>1、经纪业务</b>	685,024,680.11	883,262,131.71
<b>其中：证券经纪业务</b>	654,982,885.90	845,382,427.86
其中：代理买卖证券业务	634,396,562.89	822,956,049.18
交易单位席位租赁	5,052,149.84	9,411,512.63
代销金融产品业务	15,534,173.17	13,014,866.05
<b>期货经纪业务</b>	30,041,794.21	37,879,703.85
<b>2、投资银行业务</b>	88,669,210.48	259,124,920.94
其中：证券承销业务	20,389,386.77	170,853,739.10
保荐服务业务	2,730,188.68	14,396,226.42
财务顾问业务	65,549,635.03	73,874,955.42
<b>3、资产管理业务</b>	82,944,214.61	104,388,729.02
<b>4、基金管理业务</b>	205,214.88	
<b>5、投资咨询业务</b>		1,094,369.15
<b>6、股权托管服务业务</b>	3,128,924.13	956,655.51
<b>7、其他</b>	801,691.01	96,918.99
<b>手续费及佣金收入合计</b>	<b>860,773,935.22</b>	<b>1,248,923,725.32</b>
<b>手续费及佣金支出：</b>		
<b>1、经纪业务</b>	214,050,973.35	228,845,180.38
<b>其中：证券经纪业务</b>	214,050,973.35	228,845,180.38
其中：代理买卖证券业务	214,050,973.35	228,841,695.93
交易单位席位租赁		
代销金融产品业务		3,484.45
<b>期货经纪业务</b>		
<b>2、投资银行业务</b>		4,262,264.15
其中：证券承销业务		3,950,943.40
保荐服务业务		
财务顾问业务		311,320.75
<b>3、资产管理业务</b>		
<b>4、基金管理业务</b>		
<b>5、投资咨询业务</b>		
<b>6、股权托管服务业务</b>	32,136.00	3,000.00
<b>7、其他</b>		12,512.50
<b>手续费及佣金支出合计</b>	<b>214,083,109.35</b>	<b>233,122,957.03</b>
<b>手续费及佣金净收入</b>	<b>646,690,825.87</b>	<b>1,015,800,768.29</b>
其中：财务顾问业务净收入	65,549,635.03	73,563,634.67
—并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司	28,451,886.79	33,728,301.89
—并购重组财务顾问业务净收入-其他		835,849.05
—其他财务顾问业务净收入	37,097,748.24	38,999,483.73

## 2、 代销金融产品业务列示:

代销金融产品业务	本期数		上期数	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	1,199,887,284.32	14,437,905.24	1,356,243,759.13	11,200,346.06
其他	29,870,488,125.01	1,096,267.93	30,595,820,536.02	1,814,519.99
合计	31,070,375,409.33	15,534,173.17	31,952,064,295.15	13,014,866.05

## 3、 资产管理业务报表

项目	本期数		
	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	4.00	25.00	
期末客户数量	1,974.00	25.00	
其中：个人客户	1,952.00		
机构客户	22.00	25.00	
期初受托资金	543,112,375.34	34,650,828,672.52	
其中：自有资金投入			
个人客户	407,394,552.80		
机构客户	135,717,822.54	34,650,828,672.52	
期末受托资金	277,577,716.95	39,672,157,335.24	
其中：自有资金投入			
个人客户	191,549,321.41		
机构客户	86,028,395.54	39,672,157,335.24	
期末主要受托资产初始成本	1,951,018.83		
其中：股票	25,240,299.76		
国债			
其他债券	2,000.00	44,501,947,769.11	
买入返售金融资产	12,000,000.00	96,775,000.00	
基金	5,404,286.47		
协议或定期存款	125,398.81	1,000,000,000.00	
信托计划			
资产收益权			
银行理财计划			
专项资产管理计划		1,173,808,800.88	
收益凭证		-	
股票质押式回购		216,000,000.00	
集合资产管理计划		1,000,000.00	
银行间回购	177,607,986.41	2,055,551,931.09	
商业票据			
期货	145,694.80		
货币资金	30,783,293.77	251,447,668.82	
当期资产管理业务净收入	7,729,879.31	75,214,335.30	

(三十九) 利息净收入

项目	本期数	上期数
<b>利息收入</b>	754,247,526.68	911,893,615.48
1、存放金融同业利息收入	204,295,414.85	315,678,686.83
其中：自有资金存款利息收入	49,184,888.81	122,088,892.47
客户资金存款利息收入	155,110,526.04	193,589,794.36
2、融资融券利息收入	414,796,744.11	447,860,926.42
3、买入返售金融资产利息收入	135,155,367.72	147,608,797.37
其中：约定回购利息收入		
股权质押回购利息收入	97,804,495.43	49,727,737.22
4、拆出资金利息收入		
5、其他		745,204.86
<b>利息支出</b>	305,655,326.26	600,671,516.04
1、客户资金存款利息支出	30,291,757.06	40,226,273.45
2、卖出回购金融资产利息支出	59,345,197.16	133,690,232.73
其中：报价回购利息支出		
3、短期借款利息支出	2,552,324.10	2,457,618.00
4、拆入资金利息支出	9,649,664.46	12,584,806.60
其中：转融通利息支出		
5、长期借款利息支出		
6、应付固定收益凭证利息支出	47,869,170.30	73,562,441.72
7、次级债券利息支出	68,406,207.84	181,220,833.60
8、两融收益权转让利息支出	20,854,583.33	61,150,333.32
9、公司债券利息支出	42,405,039.70	73,200,000.00
10、纳入合并范围结构化主体其他权益人利息支出	24,075,001.89	22,578,976.62
11、其他	206,380.42	
<b>利息净收入</b>	448,592,200.42	311,222,099.44

(四十) 投资收益

1、 投资收益明细：

项目	本期数	上期数
<b>成本法核算的长期股权投资收益</b>		
<b>权益法核算的长期股权投资收益</b>	11,526,468.67	12,042,897.03
<b>处置长期股权投资产生的投资收益</b>		
<b>金融工具投资收益</b>	238,591,127.76	267,911,877.95
其中：金融工具持有期间取得的收益	206,484,772.26	284,498,333.58
—以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产	102,872,096.43	235,791,362.07
—持有至到期投资		
—可供出售金融资产	103,612,675.83	48,706,971.51
—衍生金融工具		
金融工具处置取得的收益	32,106,355.50	-16,586,455.63
—以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产	2,651,211.08	-86,258,236.87
—持有至到期投资		

项目	本期数	上期数
—可供出售金融资产	35,253,922.42	73,629,893.19
—衍生金融工具	-5,762,446.49	-3,958,111.95
—以公允价值计量且变动计入当期损益金融负债	-36,331.51	
<b>合计</b>	<b>250,117,596.43</b>	<b>279,954,774.98</b>

## 2、 对联营企业的投资收益：

被投资单位	本期数	上期数
富安达基金管理有限公司	11,495,325.29	12,042,897.03
南京东南巨石价值成长股权投资基金（有限合伙）	28,408.82	
南京巨石高投股权投资中心（有限合伙）	2,734.56	
<b>合计</b>	<b>11,526,468.67</b>	

## 3、 投资收益汇回不存在重大限制。

### (四十一) 资产处置损益

项目	本期数	上期数
非流动资产处置损益	69,361.70	7,298,177.10
其中：非经常性损益	69,361.70	7,298,177.10
<b>合计</b>	<b>69,361.70</b>	<b>7,298,177.10</b>

### (四十二) 公允价值变动收益

项目	本期数	上期数
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产公允价值变动损益	31,606,144.34	-122,740,958.95
以公允价值计量且变动计入当期损益金融负债公允价值变动损益	1,239,510.00	-1,239,510.00
衍生金融工具公允价值变动损益	-68,787.32	847,640.00
<b>合计</b>	<b>32,776,867.02</b>	<b>-123,132,828.95</b>

### (四十三) 其他业务收入

项目	本期数	上期数
房屋租赁收入	5,730,105.35	6,509,086.62
咨询收入	78,422.02	
<b>合计</b>	<b>5,808,527.37</b>	<b>6,509,086.62</b>

### (四十四) 其他收益

项目	本期数	上期数
与收益相关的政府补助	2,390,000.00	
<b>合计</b>	<b>2,390,000.00</b>	

根据财会【2017】15号《财政部关于印发修订〈企业会计准则第16号-政府补助〉的通知》文件，公司将与日常经营活动相关的政府补助统一在“其他收益”科目中列示。本期发生的其他收益系

公司控股子公司宁夏股权托管交易中心（有限公司）收到的企业挂牌服务补助款。

#### (四十五) 税金及附加

项目	本期数	上期数	计缴比例
营业税	344,493.26	29,949,353.07	5.00%
城建税	4,572,933.25	6,655,564.78	5.00%、7.00%
教育费附加、地方教育费附加	3,255,185.72	4,747,064.47	3.00%、2.00%
房产税	5,827,188.43	2,223,355.32	
残疾人就业保障金	1,654,343.98	903,705.31	
防洪保安基金	92,271.08	203,575.97	
水利建设基金	68,820.88	195,447.61	
城镇土地使用税	144,166.08	136,019.33	
印花税	156,565.36	50,910.42	
车船使用税	80,492.50	40,490.38	
其他	4,570.06	23,347.30	
合计	16,201,030.60	45,128,833.96	

#### (四十六) 业务及管理费

项目	本期数	上期数
业务及管理费合计	823,177,639.46	811,596,596.46
其中主要项目：		
工资薪酬	521,183,148.42	558,075,071.73
租赁费及物业管理费	45,060,542.91	36,700,138.62
固定资产折旧费	59,782,323.82	27,625,900.70
邮电通讯费	24,978,231.66	26,644,246.50
电子设备运转费	21,645,320.26	21,824,586.92
业务招待费	18,343,233.43	17,311,212.60
投资者保护基金	13,237,175.18	14,919,482.83
无形资产摊销	15,770,644.82	14,509,010.60
差旅费	14,035,690.70	13,649,440.22
交易所设施使用费	12,825,878.67	12,760,656.77
小计	746,862,189.87	744,019,747.49

#### (四十七) 资产减值损失

项目	本期数	上期数
坏账损失	1,097,806.48	4,912,811.65
可供出售金融资产减值准备		
买入返售金融资产减值准备	4,211,418.42	1,383,328.20
融资融券客户款坏账准备	158,870.79	-7,053,593.19
合计	5,468,095.69	-757,453.34

#### (四十八) 营业外收入

##### 1、 按照类别列示：

项目	本期数	计入当期非经常性损益金额	上期数	计入当期非经常性损益金额
政府补贴	4,685,172.33	4,685,172.33	4,718,761.22	4,718,761.22
个税返还	3,910,816.01	3,910,816.01	4,007,928.63	4,007,928.63
无法支付应付款及其他	3,365,438.39	3,365,438.39	2,660,347.23	2,660,347.23
合计	11,961,426.73	11,961,426.73	11,387,037.08	11,387,037.08

## 2、 政府补助明细:

政府补助项目	本期数	上期数	与资产/收益相关
地方扶持资金	230,000.00	230,000.00	与收益相关
金融创新奖励资金	100,000.00		与收益相关
金融机构入驻补贴资金	1,000,000.00		与收益相关
金融机构租房补贴资金	189,047.00	203,000.00	与收益相关
金融支持贡献奖励资金	70,000.00	300,000.00	与收益相关
金融机构奖励资金	43,000.00		与收益相关
财政扶持资金	293,664.00		与收益相关
企业优惠扶持资金	180,000.00	380,000.00	与收益相关
全国中小企业股份转让系统挂牌补贴资金	300,000.00	300,000.00	与收益相关
场外资本市场发展奖励		300,000.00	与收益相关
企业上市(挂牌)奖励		100,000.00	与收益相关
失业稳岗补贴资金	1,057,047.33	168,998.22	与收益相关
限售股减持奖励资金	112,414.00	358,863.00	与收益相关
新设营业部奖励资金		200,000.00	与收益相关
新设分支机构奖励资金		500,000.00	与收益相关
政府扶持资金		677,900.00	与收益相关
中小企业失业补贴资金			与收益相关
重点企业产业扶持资金	910,000.00	1,000,000.00	与收益相关
新三板挂牌企业主办做市商奖励	200,000.00		与收益相关
合计	4,685,172.33	4,718,761.22	

## (四十九) 营业外支出

项目	本期数	计入当期非经常性损益金额	上期数	计入当期非经常性损益金额
非流动资产报废损失	564,568.56	564,568.56	654,992.32	654,992.32
捐赠支出	6,808,240.93	6,808,240.93	5,815,740.00	5,815,740.00
滞纳金等	222,378.35	222,378.35	91,689.01	91,689.01
预计诉讼损失	541,766.60	541,766.60		
其他	580.92	580.92	38,688.42	38,688.42
合计	8,137,535.36	8,137,535.36	6,601,109.75	6,601,109.75

## (五十) 所得税费用

### 1、 按照类别列示:

项目	本期数	上期数
当期所得税费用	108,802,147.18	226,729,472.11

递延所得税费用	22,526,104.00	-72,019,965.06
合计	131,328,251.18	154,709,507.05

**2、 所得税费用与会计利润关系的说明：**

项目	本期数	上期数
利润总额	543,539,806.42	648,429,263.26
按法定[或适用]税率计算的所得税费用	135,884,951.61	162,107,315.81
子公司适用不同税率的影响	-576,777.73	
对以前期间所得税的调整影响	1,783.22	2,557.72
归属于合营企业和联营企业的损益	-2,881,617.17	-3,010,724.26
不征税、减免税收入	-3,656,777.01	-6,883,325.03
不得税前扣除的成本、费用和损失	2,601,374.41	2,598,155.90
本期未确认可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	-12,840.15	-73,290.59
其他	-31,846.00	-31,182.50
所得税费用	131,328,251.18	154,709,507.05

**(五十一) 收到其他与经营活动有关的现金**

项目	本期数	上期数
房租及咨询收入	4,593,195.59	6,509,086.62
营业外收入	9,002,763.93	8,899,758.87
其他收益	2,390,000.00	
代理承销证券款	845,391.18	
存出保证金	64,331,844.04	
合计	81,163,194.74	15,408,845.49

**(五十二) 支付其他与经营活动有关的现金**

项目	本期数	上期数
现金支付业务及管理费	246,404,568.68	210,916,803.85
营业外支出	7,031,200.20	5,852,020.56
代理承销证券款		5,679,817.48
存出保证金		159,494,105.39
往来款	10,049,757.20	12,512,773.12
合计	263,485,526.08	394,455,520.40

**(五十三) 收到其他与投资活动有关的现金**

项目	本期数	上期数
处置固定资产取得的净收入	227,897.77	164,037.06
其他		
合计	227,897.77	164,037.06

**(五十四) 收到其他与筹资活动有关的现金**

项目	本期数	上期数
纳入合并范围结构化主体其他委托人资金款	300,000,000.00	186,970,000.00
其他		
合计	300,000,000.00	186,970,000.00



**(五十五) 支付其他与筹资活动有关的现金**

项目	本期数	上期数
纳入合并范围特殊目的主体其他委托人资金款	615,962,776.75	135,659,548.44
其他	3,000,000.00	
合计	618,962,776.75	135,659,548.44

**(五十六) 现金及现金等价物**

项目	期末余额	年初余额
一、现金	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93
其中：库存现金	15,976.20	32,260.26
可随时用于支付的银行存款	6,234,329,418.43	8,830,100,510.67
其他货币资金		
可用于支付的存放中央银行款项		
存放同业款项		
拆放同业款项		
二、现金等价物	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31
存放登记公司结算备付金	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31
三、期末现金及现金等价物余额	8,136,835,013.49	11,134,854,750.24

**(五十七) 现金流量表补充资料**

项目	本期数	上期数
一、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	412,211,555.24	493,719,756.21
加：资产减值准备	5,468,095.69	-757,453.34
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	59,782,323.82	27,625,900.70
无形资产摊销	15,770,644.82	14,509,010.60
长期待摊费用摊销	4,275,430.79	4,093,457.81
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-69,361.70	-6,643,184.78
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	564,568.56	
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-33,021,489.52	123,132,828.95
利息支出	182,755,419.73	350,562,251.94
投资损失（收益以“-”号填列）	-11,526,468.67	-12,042,897.03
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	17,828,997.36	-39,665,808.22
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	4,697,106.63	-32,354,156.84
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产的减少（增加以“-”号填列）	277,523,214.99	1,699,980,607.22
可供出售金融资产净减少额（增加以“-”号填列）	-24,941,647.90	4,264,481,639.60
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	249,527,572.72	4,328,673,910.79
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-2,217,562,095.15	-14,312,771,404.79

项目	本期数	上期数
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-1,056,716,132.59	-3,097,455,541.18
二、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		
三、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93
减：现金的年初余额	8,830,132,770.93	11,700,955,564.26
加：现金等价物的期末余额	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31
减：现金等价物的年初余额	2,304,721,979.31	5,125,914,386.41
现金及现金等价物净增加额	-2,998,019,736.75	-5,692,015,200.43

## (五十八) 分部报告

本公司的业务活动按照产品及服务类型分为：证券经纪业务、证券自营业务、投资银行业务、资产管理业务、信用交易业务、期货经纪业务。报告分部获得收入来源的产品及服务主要类型如下：

- 1、 证券经纪业务：证券代理买卖业务；期货 IB 业务；
- 2、 证券自营业务：权益类证券投资业务；债券及相关衍生品投资业务；权益类衍生品投资业务；
- 3、 投资银行业务：股权融资业务；债券销售业务；债券及结构化融资业务；相关财务顾问业务；
- 4、 资产管理业务：集合资产管理业务；定向资产管理业务；专项资产管理业务；
- 5、 信用交易业务：融资融券业务；约定式购回、股票质押式回购业务；
- 6、 期货经纪业务：商品期货经纪业务；金融期货经纪业务；

本公司资金由财务部对外筹集并分配至各个业务部门。

本公司管理层监督各个分部的经营成果，以此作为资源分配和业绩考核的评定依据。

### 1、 2017 年度

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	信用交易业务	公司总部及其他业务	期货经纪业务	分部间相互抵消	合计
一、营业收入	568,442,527.11	238,763,347.09	89,723,516.54	80,266,333.01	498,357,660.41	-102,336,878.66	53,219,285.73	-41,873,110.43	1,384,562,680.80
手续费及佣金净收入	442,239,047.15		89,712,952.96	80,266,333.01		4,103,694.02	30,284,933.78	83,864.95	646,690,825.87
利息净收入	128,086,177.97	-32,446,621.03	10,563.58		498,357,660.41	-141,392,797.70	19,743,451.96	-23,766,234.77	448,592,200.42
投资收益		238,433,191.61				25,626,468.67	-	-13,942,063.85	250,117,596.43
其他收入	-1,882,698.01	32,776,776.51				9,325,756.35	3,190,899.99	-4,248,676.76	39,162,058.08
二、营业支出	419,405,992.54	48,643,884.00	71,218,963.64	28,944,740.97	12,505,684.44	226,033,822.18	41,843,588.51	-3,749,910.53	844,846,765.75
三、营业利润（亏损）	149,036,534.57	190,119,463.09	18,504,552.90	51,321,592.04	485,851,975.97	-328,370,700.84	11,375,697.22	-38,123,199.90	539,715,915.05
四、资产总额	7,213,827,064.85	5,909,882,555.88	66,154,722.03	27,753,841.30	8,320,500,753.42	12,761,019,765.82	797,477,288.65	-11,595,069,046.13	23,501,546,945.82
五、负债总额	6,584,324,286.83	4,946,490,697.06	29,241,817.51	28,135,339.64	7,834,648,777.45	4,144,227,342.66	632,089,474.46	-10,097,865,554.79	14,101,292,180.82
六、补充信息									
1、折旧和摊销费用	16,483,591.37	1,339,486.43	504,889.56	436,383.81	743,846.85	57,549,318.11	2,770,883.30		79,828,399.43
2、资本性支出	16,413,183.72	372,128.45	206,145.49	112,355.14	1,370,384.64	241,261,969.84	2,324,790.62		262,060,957.90

**2、 2016 年度**

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	信用交易业务	公司总部及其他业务	期货经纪业务	分部间相互抵消	合计
一、营业收入	776,949,540.32	101,629,417.65	256,799,633.00	103,884,241.59	441,917,534.90	-208,050,635.87	55,241,636.10	-28,760,054.68	1,499,611,313.01
手续费及佣金净收入	618,563,876.95		256,789,665.03	103,882,343.91		1,743,431.15	38,194,299.59	-3,372,848.34	1,015,800,768.29
利息净收入	156,037,427.84	-43,456,652.78	9,967.97	1,897.68	441,917,534.90	-236,699,696.06	15,990,596.51	-22,578,976.62	311,222,099.44
投资收益		268,218,899.38				11,936,460.56	106,436.47	-307,021.43	279,954,774.98
其他收入	1,959,235.53	-123,132,828.95				14,969,168.48	950,303.53	-2,112,208.29	-107,366,329.70
二、营业支出	428,229,736.09	90,194,716.29	104,010,652.07	42,829,060.67	19,327,517.67	133,524,123.40	43,007,985.54	-5,155,814.65	855,967,977.08
三、营业利润（亏损）	348,719,804.23	11,434,701.36	152,788,980.93	61,055,180.92	422,590,017.23	-341,574,759.27	12,233,650.56	-23,604,240.03	643,643,335.93
四、资产总额	9,275,168,219.34	6,488,900,854.15	113,615,610.06	22,677,671.69	6,812,764,979.82	13,408,554,142.01	948,138,956.10	-10,211,452,476.13	26,858,367,957.04
五、负债总额	8,763,139,486.50	5,242,440,555.43	5,677,643.11	24,297,312.89	6,489,673,284.99	4,639,151,332.80	791,164,176.09	-8,377,218,506.55	17,578,325,285.26
六、补充信息									
1、折旧和摊销费用	17,297,510.63	1,638,568.98	697,884.39	366,787.62	502,252.13	22,998,881.66	2,724,930.96		46,226,816.37
2、资本性支出	9,747,308.14	82,013.41	242,793.37	360,960.16		196,283,263.96	2,125,379.86		208,841,718.90

## 七、 合并范围的变更

### (一) 报告期内发生的非同一控制下企业合并的情况

无。

### (二) 报告期内发生的同一控制下企业合并的情况

无。

### (三) 报告期内发生的反向购买情况

无。

### (四) 报告期内新设子公司纳入合并范围情况

无。

### (五) 报告期内其他原因导致的合并范围变动

#### 1、 本期通过设立或者投资等方式新纳入合并范围的结构化主体

2017 年 5 月本公司以自有资金认购“富安达-南证量化 1 号”资产管理计划全部份额，根据合同约定享有其全部收益及承担其全部风险。综合考虑本公司所享有的结构化主体可变回报及所承担的敞口风险等因素，将本公司认定具有控制权的上述结构化主体纳入合并范围。

2017 年 2 月本公司与南京银行股份有限公司签订《第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划收益权转让合同》，本公司受让南京银行股份有限公司在《第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理合同》项下全部收益权及其他所有的权利和承担的义务，成为《第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理合同》唯一受益人。综合考虑本公司所享有的结构化主体可变回报，以及所承担的敞口风险等因素，将本公司认定具有控制权的上述结构化主体纳入合并范围。

#### 2、 本期通过处置等方式不再纳入合并范围的结构化主体

2017 年 6 月本公司与江阴华中投资管理有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》，江阴华中投资管理有限公司受让本公司在《第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理合同》项下全部收益权及其他所有的权利和承担的义务，成为《第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理合同》唯一受益人。期末本公司不再将上述结构化主体纳入合并范围。

本公司本期收回“北信利通债券投资集合资金信托”第 2 期投资组合和龙兴 506 号定向资产管理计划所认购全部份额及其收益，期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利，本期不再将其纳入合并范围。

本公司本期收回“宝通 3 号”集合资金信托计划所认购全部份额及其收益，期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利，本期不再将其纳入合并范围。

本公司本期收回“尚书 1 号”定向资产管理计划所认购全部份额及其收益，期末不再持有或享有上述结构化主体权益或权利，本期不再将其纳入合并范围。

## 八、 在其他主体中的权益

### (一) 在子公司中的权益

#### 1、 企业集团的构成

##### A、主要控股子公司

(单位：万元)

子公司名称	注册地	注册资本	法定代表人	业务性质	本公司期末实际投资额	持股比例 (%)		表决权比例 (%)		取得方式
						直接	间接	直接	间接	
南京巨石创业投资有限公司	南京市玄武区玄武大道 699-1 徐庄管委会行政楼三楼	30,000.00	夏宏伟	股权投资	30,000.00	100.00		100.00		设立
南证期货有限责任公司	南京市秦淮区长乐路 226 号长乐花园	12,575.00	夏涛	期货经纪业务	15,045.00	100.00		100.00		收购
宁夏股权托管交易中心(有限公司)	银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号西 17 层 1708 室	6,000.00	李剑锋	股权登记托管	3,060.00	51.00		51.00		设立

##### B、纳入合并范围的结构化主体

结构化主体名称	产品类型	期末余额/本期数				
		实际持有份额	计划份额总计	持有比例 (%)	期末净资产	本期净利润
南京证券神州 4 号股票精选集合资产管理计划	非限定型集合资产管理计划	6,009,822.52	37,783,079.06	16	36,174,316.55	1,254,398.20
龙兴 506 号定向资产管理计划	定向资产管理计划					-4,487.67
尚书 1 号定向资产管理计划[注]	定向资产管理计划					3,340,081.01
北信利通债券投资集合资金信托	集合信托资金计划					-
宝通 3 号集合资金信托计划	集合信托资金计划					10,751,138.19
第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划	定向资产管理计划					14,374,500.00
宝通 2 号集合资金信托计划	集合资金信托	50,000,000.00	350,000,000.00	14	353,302,101.39	16,475,641.10
富安达-南证量化 1 号资产管理计划	定向资产管理计划	100,000,000.00	100,000,000.00	100	97,805,263.03	-2,194,736.97

本公司对结构化主体是否应纳入合并范围进行判断，包括本公司作为管理人的结构化主体和本公司投资的由其他机构发行的结构化主体。本公司对于本公司作为管理人的结构化主体和本公司投资的由其他机构发行的本公司作为投资顾问制定投资决策的结构化主体拥有

权力，本公司参与该等结构化主体的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。

## 2、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
宁夏股权托管交易中心(有限公司)	49.00	1,612,473.87		30,916,232.38
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	27.00	-3,674.99		2,705,345.98

## 3、重要的非全资子公司的主要财务信息

子公司名称	项目	期末余额/本期数	年初余额/上期数
宁夏股权托管交易中心(有限公司)	流动资产	61,660,993.41	47,969,582.57
	非流动资产	4,815,742.61	17,772,852.81
	资产合计	66,476,736.02	65,742,435.38
	流动负债	3,382,384.22	5,938,846.59
	非流动负债		
	负债合计	3,382,384.22	5,938,846.59
	营业收入	8,153,465.32	3,239,843.10
	净利润	3,290,763.01	293,163.73
	综合收益总额	3,290,763.01	293,163.73
	经营活动净现金流量	-46,511,347.95	31,277,094.29

4、 本公司拥有半数以上表决权但未能对其形成控制的被投资单位  
无。

5、 纳入合并财务报表范围但母公司拥有其半数或半数以下表决权的子公司  
无。

6、 使用企业资产和清偿企业债务存在重大限制  
无。

7、 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持

本公司作为纳入合并范围的结构化主体的管理人或投资顾问，提供合同约定的管理或者投资顾问服务，同时以自有资金参与次级权益，除此之外未提供其他财务支持。

(二) 本公司报告期内在子公司的所有者权益份额变化且仍控制子公司的交易  
无。

### (三) 在联营企业中的权益

#### 1、 重要的联营企业

被投资单位名称	注册地	业务性质	注册资本	持股比例 (%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
富安达基金管理 有限公司	中国（上海）自 由贸易试验区世 纪大道 1568 号 29 楼	基金募集、基金销售、资 产管理业务和中国证监 会许可的其他业务	513,000,000.00	49.00		权益法
南京东南巨石价 值成长股权投资 基金（有限合伙）	南京市栖霞区仙 林街道学津路 8 号高创大厦 B 座 301 室	项目投资管理；项目投资 咨询	100,000,000.00	18.00		权益法
南京巨石高投股 权投资中心（有 限合伙）	南京市玄武区大 钟亭 8 号	项目投资管理；项目投资 咨询	50,000,000.00	18.00		权益法

2017 年本公司参股设立南京东南巨石价值成长股权投资基金（有限合伙）和南京巨石高投股权投资中心（有限合伙），本公司为执行事务合伙人，投资比例为 18%，综合考虑参股公司设立目的、合伙协议、相关业务活动开展规则等因素，本公司对南京东南巨石价值成长股权投资基金（有限合伙）和南京巨石高投股权投资中心（有限合伙）具有重大影响。

#### 2、 重要联营企业的主要财务信息

单位：万元

被投资单位 名称	本企业在被 投资单位表 决权比例	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	本期其他综 合收益
富安达基金管理 有限公司	49.00%	49,371.97	5,383.43	43,988.54	13,419.71	2,345.98	-772.08
南京东南巨石价 值成长股权投资 基金（有限合伙）	18.00%	10,015.78		10,015.78	38.79	15.78	
南京巨石高投股 权投资中心（有 限合伙）	18.00%	5,001.52		5,001.52	12.38	1.52	

#### 3、 联营企业向本公司转移资金的能力存在的重大限制

无。

### (四) 报告期内发生的重要共同经营

无。

### (五) 本公司在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本公司通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括基金、其他理财产品等。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式为向投资者发行投资产品。

期末合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本公司因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，列示如下：



项目	可供出售金融资产	以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	合计
基金	69,575,684.26	6,803,502.12	76,379,186.38
其他理财产品	346,465,000.00		346,465,000.00
合计	416,040,684.26	6,803,502.12	422,844,186.38

#### (六) 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定向和集合资产管理计划。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收取管理费。报告期内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收取管理费收入。

期末本公司不存在通过直接持有本公司发起设立的未纳入合并范围的结构化主体中享有权益。

#### (七) 境外经营实体主要报表项目的折算汇率

本公司无境外经营实体。

### 九、 关联方关系及其交易

#### (一) 本公司控股股东情况

关联方名称	关联关系	企业类型	注册地	法定代表人	业务性质	注册资本	对本公司的持股比例(%)	对本公司的表决权比例(%)	本公司实际控制人	组织机构代码
南京紫金投资集团有限责任公司	控股股东	有限公司(法人独资)内资	江苏南京	王海涛	实业投资、资产管理、财务咨询、投资咨询	500,000.00 万元	30.16	34.47	南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司	91320100674919806G

#### (二) 本公司的子公司

子公司名称	子公司类型	企业类型	注册地	法定代表人	注册资本	持股比例(%)	表决权比例(%)	组织机构代码
南证期货有限责任公司	全资子公司	金融期货	南京	夏涛	12,575.00 万元	100.00	100.00	10002191-7
南京巨石创业投资有限公司	全资子公司	股权投资	南京	夏宏伟	30,000.00 万元	100.00	100.00	91320102593537638L
南京巨石金川股权投资基金管理有限	全资子公司	股权投资	南京	夏宏伟	5,000.00 万元	100.00	100.00	91320102MA1MFE9926

子公司名称	子公司类型	企业类型	注册地	法定代表人	注册资本	持股比例(%)	表决权比例(%)	组织机构代码
公司								
宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司	控股子公司	股权投资	宁夏	赵贵成	1,000.00 万元	73.00	73.00	91640100MA75WQAP8C
宁夏股权托管交易中心(有限公司)	控股子公司	股权托管	宁夏	李剑锋	6,000.00 万元	51.00	51.00	91640000317882451U

### (三) 本公司的联营企业

公司名称	注册地址	法定代表人/执行事务合伙人	主营业务	注册资本	持股比例(%)	表决权比例(%)	是否合并报表
富安达基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1568号29楼	蒋晓刚	基金募集、基金销售、资产管理业务和中国证监会许可的其他业务	51,300.00 万元	49.00	49.00	否
南京东南巨石价值成长股权投资基金(有限合伙)	南京市栖霞区仙林街道学津路8号高创大厦B座301室	南京巨石创业投资有限公司	股权投资; 项目投资管理; 项目投资咨询。	20,000.00 万元	18.00	18.00	否
南京巨石高股权投资中心(有限合伙)	南京市玄武区大钟亭8号	南京巨石创业投资有限公司、江苏省高科技产业投资股份有限公司	股权投资; 项目投资管理; 项目投资咨询。	10,000.00 万元	18.00	18.00	否

### (四) 其他关联方

关联方名称	关联方关系
富安达资产管理(上海)有限公司	联营企业控股子公司
南京新工投资集团有限责任公司	持有发行人5%以上股份的其他股东
江苏凤凰置业有限公司	持有发行人5%以上股份的其他股东
南京市交通建设投资控股(集团)有限责任公司	持有发行人5%以上股份的其他股东
南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司	公司实际控制人
南京安居建设集团有限责任公司	公司实际控制人控制的企业
南京新港开发总公司	公司实际控制人控制的企业
南京旅游集团有限责任公司(注)	公司实际控制人控制的企业
南京新农发展集团有限责任公司	公司实际控制人控制的企业
南京纺织品进出口股份有限公司	公司实际控制人控制的企业

南京商厦股份有限公司	公司实际控制人控制的企业
南京商业广告有限责任公司	公司实际控制人控制的企业
南京白宫大酒店	公司实际控制人控制的企业
南京金谷创客空间中心	公司实际控制人控制的企业
南京市保安服务总公司	公司实际控制人控制的企业
南京农垦产业（集团）有限公司	公司实际控制人控制的企业
南京新农科创投资有限责任公司	公司实际控制人控制的企业
南京国资投资置业有限公司	公司实际控制人控制的企业
南京建设发展集团有限公司	公司实际控制人控制的企业
南京市市民卡有限公司	控股股东控制的企业
南京紫金资产管理有限公司	控股股东控制的企业
紫金信托有限责任公司	控股股东控制的企业
南京金融城建设发展股份有限公司	控股股东控制的企业
南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司	控股股东控制的企业
南京市高新技术风险投资股份有限公司	控股股东控制的企业
南京国资资产处置有限责任公司	控股股东控制的企业
步国甸、王海涛、李剑锋、陈峥、肖玲、毕胜、代士健、李小林、孙隽、吴斐、李心丹、陈传明、孙文俊、张宏、李明辉、陈晏、黄涛、吴捷、周坚宁、穆康、胡晨顺、闻长兵、夏宏建、秦雁、黄锡成、江念南、邱楠、刘宁、校坚、赵贵成及关系密切家庭成员	董事、监事（包括职工监事）、高级管理人员及关系密切家庭成员
周力平、马建勋、管毅、王雁、张颖、李小军、倪忠翔	控股股东董事、监事、高级管理人员；控股股东的控股股东之董事、监事、高级管理人员
齐世洁及关系密切的家庭成员（截止日 2017 年 5 月）	董事、监事（包括职工监事）、高级管理人员及关系密切家庭成员
董立新、骆芝惠（截止日 2017 年 2 月） 黄伟（截止日 2017 年 9 月）	控股股东董事、监事、高级管理人员；控股股东的控股股东之董事、监事、高级管理人员
江苏股权交易中心有限责任公司	主要关联自然人及与其关系密切的家庭成员控制的、或担任董事、高级管理人员的其它企业
南京银行股份有限公司	主要关联自然人及与其关系密切的家庭成员控制的、或担任董事、高级管理人员的其它企业
南京长江发展股份有限公司	主要关联自然人及与其关系密切的家庭成员控制的、或担任董事、高级管理人员的其它企业
南京中成创业投资有限公司（截止日 2017 年 2 月，董立新兼任）	主要关联自然人及与其关系密切的家庭成员控制的、或担任董事、高级管理人员的其它企业

注：2017 年 11 月，南京商贸旅游发展集团有限责任公司于 2017 年更名为南京旅游集团有限责任公司。

其他关联方包括：本公司控股股东及其子公司、持本公司 5%以上股份的股东；本公司董事、监事、高级管理人员及与其关系密切的家庭成员；因本公司董事、监事、高级管理人员及与其关系密切的家庭成员在本公司以外兼任董事及高级管理人员而与本公司构成关联关系的单位。公司独立董事兼任独立董事的单位不作为公司关联方。

#### (五) 本期发生的重要关联方交易（以下金额如无特别标注均为人民币元）

- 1、 存在控制关系且已纳入本公司合并财务报表范围的子公司、结构化主体，其相互之间交易及母子公司交易已作抵消。

## 2、 代理买卖证券款

关联方名称	期末余额	年初余额
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	9,289,710.77	300,514.92
南京纺织品进出口股份有限公司	773.3	770.57
南京国有资产处置有限责任公司	0.01	0.01
南京金谷创客空间中心	3.19	3.19
南京旅游集团有限责任公司（注）	257,889.83	18,392.26
南京市保安服务总公司	388,305.92	316,062.77
南京市高新技术风险投资股份有限公司	9,464.80	1,678,073.02
南京市国有资产管理控股（集团）有限责任公司	4,514.87	99,866.12
南京市市民卡有限公司	1.02	1.02
南京新工投资集团有限责任公司	448.16	446.57
南京新农发展集团有限责任公司	203.81	462,682.00
南京新农科创投资有限责任公司	671.59	669.21
南京长江发展股份有限公司	5,630.28	610,661.72
南京中成创业投资有限公司	565.53	563.54
南京紫金投资集团有限责任公司	210,267.90	674.01
南京紫金资产管理有限公司	1,327.12	16.50
南京商厦股份有限公司	640.61	638.34
南京白宫大酒店	306.88	305.80
南京农垦产业（集团）有限公司	68.05	68.75
关联自然人	466,838.44	647,902.80
合计	10,637,632.08	4,138,313.12
占代理买卖证券款余额比例	0.15%	0.04%

注：南京商贸旅游发展集团有限责任公司于 2017 年更名为南京旅游集团有限责任公司，下同。

## 3、 代理买卖证券手续费及佣金收入

关联方名称	本期数	上期数
	人民币	人民币
南京市高新技术风险投资股份有限公司		39,961.72
南京旅游集团有限责任公司	36,382.19	3,959.68
关联自然人	72,571.47	100,208.33
南京紫金资产管理有限公司	18,078.40	
南京新工投资集团有限责任公司		580.68
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	990,656.53	1,044,579.18
南京长江发展股份有限公司	138.55	11,550.44
合计	1,117,827.14	1,200,840.03
占代理买卖证券手续费及佣金收入比例	0.18%	0.15%

#### 4、 证券经纪业务客户存款利息支出

关联方名称	本期数	上期数
富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	65,524.63	191,866.11
南京纺织品进出口股份有限公司	2.73	3,811.23
南京旅游集团有限责任公司	13,672.56	876.04
南京市保安服务总公司	1,230.13	1,019.51
南京市高新技术风险投资股份有限公司	2,013.94	75,438.30
南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司	357.35	2,312.00
南京新工投资集团有限责任公司	1.59	1,112.45
南京新农发展集团有限责任公司	607.81	1,557.90
南京新农科创投资有限责任公司	2.38	2.37
南京长江发展股份有限公司	665.12	7,831.49
南京中成创业投资有限公司	1.99	2.00
南京紫金投资集团有限责任公司	17,358.11	6,923.90
南京紫金资产管理有限公司	1,337.29	565.26
南京商厦股份有限公司	2.27	72.56
南京白宫大酒店	1.08	2.71
南京农垦产业（集团）有限公司	68.17	68.75
关联自然人	2,446.17	5,628.14
合计	105,293.32	299,090.72
占代理买卖证券客户资金利息支出比例	0.35%	0.74%

#### 5、 第三方资金存管业务

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	本期数		上期数	
			金额	比例(%)	金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	客户资金存管费	协议价	149,300.74	0.96	130,451.42	0.71

#### 6、 交易单元席位租赁

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	本期数		上期数	
			金额	比例(%)	金额	比例(%)
富安达基金管理有限公司	席位租赁业务	协议价	615,549.70	12.18	7,994,500.97	84.94

#### 7、 代理销售金融产品

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	本期数	上期数
南京银行股份有限公司	代理销售金融产品	协议价	1,037,407.05	147,979.83
富安达基金管理有限公司（注）	代理销售金融产品	协议价	4,517,903.75	5,363,138.53
紫金信托有限责任公司	代理销售金融产品	协议价		
合计			5,555,310.80	5,511,118.36
占代销金融产品收入比例			35.76%	42.34%

注：包括富安达基金管理有限公司及其控股子公司富安达资产管理（上海）有限公司；代理关联方产品产生的手续费收入包括代理销售及申购、赎回金融资产产生的手续费收入。

#### 8、 保荐、承销与财务顾问业务

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	本期数	上期数
南京银行股份有限公司	保荐与承销收入	协议价		24,982,622.64
南京国资投资置业有限公司	保荐与承销收入	协议价		8,490,566.04
富安达基金管理有限公司（注）	财务顾问收入	协议价	1,326,675.85	1,388,031.99
南京银行股份有限公司	财务顾问收入	协议价	3,419,811.32	1,812,500.00
紫金信托有限责任公司	财务顾问收入	协议价	7,895,946.30	
合计			12,642,433.47	36,673,720.67
占投资银行业务收入比例			14.26%	14.15%

注：包括富安达基金管理有限公司及控股子公司富安达资产管理（上海）有限公司。

#### 9、 债券交易业务

关联方名称	定价原则	本期数			
		买入全价	买入净价	卖出全价	卖出净价
南京银行股份有限公司	市场价	67,075,089.59	66,947,370.00	301,917,906.16	294,602,550.00

关联方名称	定价原则	上期数			
		买入全价	买入净价	卖出全价	卖出净价
南京银行股份有限公司	市场价	379,313,784.68	371,194,510.00	481,369,375.45	476,385,140.00
紫金信托有限责任公司	市场价	20,809,978.08	20,200,000.00	140,744,585.22	139,374,520.00

#### 10、 除证券经纪业务客户资金利息支出外其他业务利息收入、支出

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	本期数	
			金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	资金存放业务利息收入	市场价	12,517,383.26	6.13

关联方名称	业务性质	关联交易定价原则	上期数	
			金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	资金存放业务利息收入	市场价	30,917,278.37	9.79
南京银行股份有限公司	债券回购业务利息支出	市场价	28,657.53	0.02
南京银行股份有限公司	资金拆入业务利息支出	市场价	37,583.33	0.30
富安达基金管理有限公司控股子公司管理的资管计划	固定收益凭证利息支出	市场价		
南京银行股份有限公司及其控股子公司管理的资管计划		市场价	5,302,500.00	7.21

富安达基金管理有限公司及控股子公司管理的资管计划	融资融券收益权债务工具利息支出	市场价	8,787,000.00	14.37
南京银行股份有限公司		市场价	35,787,777.78	58.52
关联自然人	固定收益凭证利息支出	市场价	11,355.00	0.02

#### 11、 公司为管理人、关联方为委托人的资产管理业务

关联方名称	资产管理计划名称	关联交易定价原则	业务性质	本期数	
				金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	南京证券-广发银行-南京银行定向资产管理合同	市场价	资产管理业务收入	99,810.72	0.12
江苏股权交易中心有限责任公司	南证稳赢 1 号资产管理计划	市场价	资产管理业务收入	15,037.64	0.00
南京银行股份有限公司	南京证券-南京银行定向 2 号资产管理合同	市场价	资产管理业务收入	265,882.50	0.32

关联方名称	资产管理计划名称	关联交易定价原则	业务性质	上期数	
				金额	比例(%)
南京银行股份有限公司	南京证券-广发银行-南京银行定向资产管理合同	市场价	资产管理业务收入	248,921.02	0.24
江苏股权交易中心有限责任公司	南证稳赢 1 号资产管理计划	市场价	资产管理业务收入	16,186.38	0.02
南京银行股份有限公司	南京证券-南京银行定向 2 号资产管理合同	市场价	资产管理业务收入	503,762.70	0.48

#### 12、 本公司纳入合并范围的资产管理计划向关联方支付资产管理费

关联方名称	资产管理计划名称	关联交易定价原则	业务性质	本期数	
				金额	比例(%)
富安达资产管理(上海)有限公司	富安达-南证量化 1 号资产管理计划	市场价	资产管理费支出	194,576.61	12.36

#### 13、 本公司向关联方收取基金管理服务费

关联方名称	关联交易定价原则	业务性质	本期数	
			金额	比例(%)
南京东南巨石价值成长股权投资基金(有限合伙)	市场价	基金管理费	144,129.98	70.23
南京巨石高投股权投资中心(有限合伙)	市场价	基金管理费	61,084.90	29.77

#### 14、 本公司认购(申购)和赎回关联方管理并发行的资产管理产品、理财产品

关联方名称	产品名称	关联交易定价原则	本期数		
			申购份额	赎回份额	期末持有份额
富安达基金管理有限公司	富安达-大朴汇升定增 2 号专项资产管理计划	市场价		10,005,800.00	-
富安达基金管	富安达新动力灵活	市场价		9,999,000.00	-

理有限公司	配置混合型证券投资基金				
富安达基金管理 有限公司	富安达现金通货 币市场证券投资基 金 B	市场价	191,603,556.54	191,603,556.54	-
南京银行股份 有限公司	理财产品	市场价	1,679,610,000.00	1,680,915,000.00	226,465,000.00
富安达基金管 理有限公司	富安达健康人生灵 活配置混合型证券 投资基金	市场价		4,999,000.00	-
富安达基金管 理有限公司	富安达消费主题灵 活配置混合证券投 资基金	市场价	19,998,675.00	5,000,000.00	14,998,675.00

关联方名称	产品名称	关联交易定 价原则	上期数		
			申购份额	赎回份额	期末持有份额
富安达基金管 理有限公司	富安达-大朴汇升 定增 1 号专项资产 管理计划	市场价		1,000,000.00	-
富安达基金管 理有限公司	富安达-大朴汇升 定增 2 号专项资产 管理计划	市场价	10,005,800.00		10,005,800.00
富安达基金管 理有限公司	富安达优势成长混 合型证券投资基金	市场价		10,578,123.35	-
富安达基金管 理有限公司	富安达卓越三十四 号专项资产管理计 划	市场价		50,000,000.00	-
南京银行股份 有限公司	理财产品	市场价	4,825,070,000.00	5,104,500,000.00	227,770,000.00
富安达基金管 理有限公司	富安达健康人生灵 活配置混合型证券 投资基金	市场价			4,999,000.00
富安达基金管 理有限公司	富安达现金通货 币市场证券投资基 金 B	市场价	378,255.71	20,930,196.74	-
富安达基金管 理有限公司	富安达新动力灵活 配置混合型证券投 资基金	市场价	9,999,000.00		9,999,000.00

备注：上表中申购、赎回份额包含了红利再投资、基金转换等因素增减份额；富安达基金管理有限公司包  
括富安达基金管理有限公司及其子公司富安达资产管理（上海）有限公司。

#### 14、报告期内董事、监事及高级管理人员薪酬

单位：万元

关联方名称	本期数	上期数
董事、监事及高级管理人员	662.42	1,086.93

#### 15、本公司与关联方共同投资业务

2014 年 3 月，本公司与南京银行股份有限公司共同认购北信利通债券投资集合资金信托计  
划份额，其中本公司认购 3,500.00 万份次级份额；南京银行股份有限公司认购 30,000.00 万



份优先级份额。2014 年 9 月，本公司和南京银行股份有限公司分别赎回 1,500.00 万份、12,000.00 万份信托份额。2015 年 9 月，本公司和南京银行股份有限公司分别赎回 1,000.00 万份、9,000.00 万份信托份额。2016 年 10 月本公司和南京银行股份有限公司分别赎回 1,000.00 万份、9,000.00 万份信托份额。本公司为北信利通债券投资集合资金信托计划投资顾问。2014 年度本公司应计优先级利息 1,342.77 万元，2015 年度本公司应计优先级利息 937.36 万元，2016 年度本公司应计优先级利息 349.42 万元。报告期期末上述交易往来款余额见附注九-（五）-17。

2016 年 11 月，本公司与南京银行股份有限公司共同认购北京信托宝通 3 号集合资金信托计划份额，其中本公司认购 1,900.00 万份次级份额，南京银行股份有限公司认购 17,100.00 万份优先级份额。2017 年 10 月本公司和南京银行股份有限公司分别赎回所认购全部份额。2016 年本公司应计优先级利息 133.99 万元，2017 年本公司应计优先级利息 729.21 万元。报告期期末上述交易往来款余额见附注九-（五）-17。

#### 16、其他重要关联方交易

2011 年、2013 年、2014 年及 2015 年本公司分别支付给控股股东南京紫金投资集团有限责任公司控股子公司南京金融城建设发展股份有限公司 100,000,000.00 元、50,000,000.00 元、219,340,000.00 元、157,519,574.00 元，合计金额 526,859,574.00 元，全部用于购买新办公大楼即南京金融城 5#楼及裙楼，合同价款 563,551,020.00 元。

2014 年本公司与南京金融城建设发展股份有限公司签署《南京金融城 5#楼“受托代建室内精装修及机电工程”服务合同》，本公司委托南京金融城建设发展股份有限公司负责南京金融城 5#楼室内精装修和机电工程，投资估算金额为 15,000.00 万元。同时协议约定本公司按照投资总额的 3%费率（监理费除外）向南京金融城建设发展股份有限公司支付代建服务费，代建服务费估算金额为 450.00 万元。2015 年本公司按照合同约定支付服务费 225.00 万元。2017 年本公司列支代建服务费 225.00 万元。

2008 年 12 月，本公司与南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司签订《协议书》，双方约定南京国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司将其拥有的南京市中山南路 311 号房产提供给本公司使用，交易金额为零。该房产一直由本公司使用至今。

2016 年 8 月，本公司与南京市国有资产投资管理控股（集团）有限责任公司签订《南京证券股份有限公司面向合格投资者公开发行公司债券担保协议》。南京市国有资产投资管理控

股（集团）有限责任公司同意为本公司公开发行债券提供担保。

2016 年 12 月，本公司与南京银行股份有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》。本公司将持有的“第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划”的全部收益权及其他权利和义务以 371,970,250.00 元价格转让给关联方南京银行股份有限公司，转让时委托资产总额 370,000,000.00 元，本公司取得收益 1,970,250.00 元。2017 年 2 月，本公司与南京银行股份有限公司签订《资产管理计划收益权转让协议》，本公司以 376,202,638.89 元价格受让南京银行股份有限公司持有的“第一创业证券股票质押 40 号定向资产管理计划”的全部收益权及其他权利和义务。

本公司与南京金融城建设发展股份有限公司签订《南京金融城地下停车位租赁协议》，本次该车位租赁期限为一年，自 2017 年 3 月 31 日至 2018 年 3 月 31 日，合同总价款 131.475 万元。2017 年本公司列支车位租赁费 93.91 万元。

2017 年本公司向参股公司富安达基金管理有限公司同比例增资 11,025.00 万元，增资后出资比例为 49%。

本公司与南京金融城建设发展股份有限公司签订《南京金融城地下停车位转让协议》，车位合同总价款 2,515.20 万元。

本公司与南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司签订《物业服务合同》。2017 年度本公司列支物业管理费 597.59 万元，先行支付能源周转金 41.14 万元，年末收回。交易往来款余额见附注九-（五）-17，同时南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司为本公司代收代缴水、电、空调能源费合计 442.42 万元。

本公司与南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司签订《金融城地下停车场管理服务协议》和《金融城地面车位管理服务协议》。2017 年度本公司列支车位管理费 64.25 万元，

根据公司与南京市保安服务总公司及其下属分公司签署的《保安服务合同》，公司部分南京地区分支机构委托其提供保安服务，2015-2017 年发生的保安费分别为 106.09 万元、121.66 万元和 135.52 万元。

## 17、 报告期末关联方交易业务资金余额及往来款余额

(1) 资产负债表日，第三方资金存管业务、债券回购业务余额

关联方名称	业务性质	科目名称	期末余额	
			余额	比例(%)
南京银行股份有限公司	资金存放业务	银行存款	188,791,700.40	3.03

关联方名称	业务性质	科目名称	年初余额	
			余额	比例(%)
南京银行股份有限公司	资金存放业务	银行存款	131,798,214.45	1.49

(2) 资产负债表日，其他关联方交易往来款余额

关联方名称	会计科目	期末余额	年初余额
南京金融城建设发展股份有限公司	在建工程-预付购房款		526,859,574.00
南京金融街第一太平戴维斯物业服务有限公司	其他负债-物业费、水电费、空调能源费	508,720.45	
南京金融城建设发展股份有限公司	其他负债-代建服务费	849,056.60	
南京金融城建设发展股份有限公司	其他负债-应付车位款	24,893,392.85	
南京金融城建设发展股份有限公司	其他负债-应付购房款	36,372,805.71	36,691,446.00
南京银行股份有限公司	其他负债-应付存管费	4,342.72	7,494.63
富安达基金管理有限公司	应付款项	74,688.76	
紫金信托有限责任公司	应收账款	26,611.11	
富安达基金管理有限公司	应收账款	41,670.65	
紫金信托有限责任公司	其他负债-预收账款	943,537.34	
南京银行股份有限公司			172,340,970.90
南京紫金投资集团有限责任公司(注)	其他负债-应付纳入合并范围特殊目的主体其他收益人款	9,574,335.09	9,249,323.72
南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司(注)		19,361,960.36	18,704,697.24

注：报告期其他负债-应付纳入合并范围特殊目的主体其他收益人款余额系南京紫金投资集团有限责任公司、南京市国有资产投资管理控股(集团)有限责任公司所购买的纳入合并范围结构化主体“神州四号”产品份额以及南京银行股份有限公司所购买的纳入合并范围结构化主体北信利通债券投资集合资金信托计划和北京信托宝通 3 号集合资金信托计划产品份额。

**18、 本期本公司关联方认定充分，关联交易的审议程序合规，关联交易真实、有效，不存在发生明显偏离市场公允价格的情形，不存在虚构交易、实质为关联交易的情形。**

**十、或有事项**

1、 因本公司原营业部员工石某私刻公司印章和虚构理财产品，对常某、王某等 43 名自然人实施非

法集资和诈骗，2013 年常某、王某等 43 名自然人先后以“财产损害赔偿纠纷”为案由起诉本公司及其南京常府街证券营业部，要求本公司赔偿共计 1,300.842 万元以及投入资金之日起按照中国人民银行同期贷款利率计至实际给付之日起的利息。

2014 年 9 月，南京市玄武区人民法院启动对其中两名原告（常某，王某）相关诉讼案件的审理工作。

2016 年 2 月 6 日，南京市玄武区人民法院对常某诉南京证券案作出“2013 玄民初字第 1940 号”《民事判决书》：由公司常府街证券营业部赔偿常某本金及利息损失 8,237,641.16 元（利息计算至 2015 年 6 月 30 日），以及自 2015 年 7 月 1 日起以 7,984,644.8 元为本金，按同期银行五年期存款基准利率计算至实际付款之日的利息的 70%；公司对公司常府街证券营业部上述债务承担清偿责任。2016 年 3 月 7 日，公司及公司常府街证券营业部依法向南京市中级人民法院提起上诉。基于谨慎性原则，并综合法律专业人士意见，本公司于 2015 年 12 月 31 日对上述诉讼案件计提预计负债 1,300.842 万元。

2016 年 8 月 29 日，江苏省南京市中级人民法院作出“(2016)苏 01 民终 3728 号”《民事裁定书》：撤销南京市玄武区人民法院 2013 玄民初字第 1940 号民事判决；将案件发回南京市玄武区人民法院重审。2017 年 3 月 16 日南京市玄武区人民法院恢复开庭审理上述案件。

此外，除上述两名原告之外的其他 41 名原告的相关诉讼，南京市玄武区人民法院已于 2015 年 2 月 12 日下达“(2015)玄民初字第 266 号”、“(2015)玄民初字第 267 号”、“(2015)玄民初字第 268 号”《民事裁定书》，裁定上述两名原告之外的其他 41 名原告所诉案件中止审理。

经南京市玄武区人民法院调解，本公司于 2017 年 6 月 16 日就上述案件与受害人达成和解，南京市玄武区人民法院出具(2016)苏 0102 民初 5469 号以及(2017)苏 0102 民初 1817-1858 号民事调解书，本公司支付 43 名受害人款项 10,049,757.21 元。

- 2、本公司原营业部员工石某私刻公司印章和虚构理财产品，本期张某、宫某等 7 名受害人向南京市玄武区人民法院提起诉讼，要求本公司赔偿其财务损失合计 541,766.60 元。截至 2017 年 12 月 31 日，该案件已被南京市玄武区人民法院受理并在审理中。鉴于谨慎性原则，本公司本期计提预计诉讼损失 541,766.60 元。

## 十一、承诺事项

### (一) 资本性支出承诺事项

报告期内本公司向南京金融城建设发展股份有限公司购置新办公大楼，截至 2017 年 12 月 31 日，本公司已支付款项 52,685.96 万元，根据已签订合同，未来经营期间合计需支出款项 3,669.14 万元。根据已签订办公大楼装修、车位及设备采购等合同文件，截至 2017 年 12 月 31 日，本公司未来经营期间合计需支出款项 7,054.74 万元。

根据 2017 年 12 月公司签订的《富安达基金管理有限公司增资协议》，公司参与富安达基金管理有限公司增资并认缴出资 25,970 万元，其中第一期出资已于 2017 年 12 月 31 日前到位，第二期出资 14,945 万元约定于 2018 年 6 月 8 日前到位。

## (二) 经营租赁承诺事项

根据已签订的不可撤销的经营性租赁合同，本公司未来最低应支付的租金金额列示如下：

项目	发生额
1 年以内	33,813,505.97
1-2 年	24,791,301.37
2-3 年	19,616,294.91
3 年以上	17,047,202.39
合计	95,268,304.64

## (三) 对外资产质押承诺

本公司部分债券（其中包含买断式回购的债券）被用作卖出回购业务的质押物，期末质押品金额如下：

项目	期末余额
卖出回购证券协议	2,859,381,144.71
质押品价值	3,011,446,139.18
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中的债券	891,343,850.00
可供出售金融资产中的债券	1,245,122,594.61
买入返售金融资产中的债券	329,207,480.00
融资融券收益权	545,772,214.57

## 十二、资产负债表日后事项

1、2018 年 2 月，本公司第二届董事会第十四次会议审议通过 2017 年度利润分配方案，2017 年度不进行利润分配。

2、2012 年，本公司与重庆市全鼎投资咨询有限公司（“重庆全鼎投资”）签订合作协议书。因重庆全鼎投资未按约履行义务，本公司未向其支付合同价款。2014 年，重庆全鼎投资向南京市玄武区人民法院提起诉讼，要求本公司支付合同价款及相关利息合计 4,945,561.25 元。本公司于 2015 年度计提预计诉讼损失 247.28 万元。2016 年 5 月 27 日，南京市玄武区人民法院作出一审判决，判处本公司败诉，本公司应支付合同价款及相关利息。本公司就重庆全鼎投资合同纠纷案向南京市中级人民法院提起上诉。2016 年 12 月 5 日，南京市中级人民法院作出终审判决：撤销一审判决，驳回重庆市全鼎投资咨询有限公司的诉讼请求。2017 年 12 月，江苏省高级人民法院向本公司下发传票，重庆市全鼎投资咨询有限公司因不服江苏省南京市中级人民法院做出的（2016）苏 01 民终 6599 号民事判决向江苏省高级人民法院申请再审，江苏省高级人民法院通知本公司接

受法院询问。2018 年 2 月 1 日江苏省高级人民法院下发【2017】苏民申 4328 号《民事裁定书》，驳回重庆全鼎投资的再审申请。

### 十三、其他事项

#### (一) 以公允价值计量的资产和负债

项目	年初余额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值准备	期末余额
以公允价值计量的金融资产					
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	2,203,608,567.02	31,606,144.34			1,957,691,496.37
衍生金融资产		-244,622.50			-
可供出售金融资产	2,401,758,263.12		-13,358,889.20		2,372,278,138.55
金融资产小计	4,605,366,830.14	31,361,521.84	-13,358,889.20	-	4,329,969,634.92
投资性房地产					
上述合计	4,605,366,830.14	31,361,521.84	-13,358,889.20	-	4,329,969,634.92
以公允价值计量的金融负债					
以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	57,720,060.00	1,239,510.00			
衍生金融负债		175,835.18			1,051,600.00

#### (二) 社会责任履行情况

报告期内，本公司为履行社会责任，在公益性方面的投入金额及构成列示如下：

期间	内容	金额
2016 年度	救助困难群众捐款	16,000.00
2016 年度	宁夏回族自治区总工会捐款	2,000,000.00
2016 年度	溧水区晶桥镇孔家村扶贫款	100,000.00
2016 年度	证券行业扶贫专项基金捐款	150,000.00
2016 年度	南京关爱好人捐赠	300,000.00
2016 年度	阜宁、射阳 6.23 灾区捐款	1,000,000.00
2016 年度	江苏省青少年发展基金会捐赠	15,000.00
2016 年度	南京市玄武区益生儿童发展基金会捐赠	50,000.00
2016 年度	宁夏彭阳县草庙乡周庄村扶贫捐赠	60,000.00
2016 年度	“安全知识进校园我为孩子捐本书”捐赠	3,740.00
2016 年度	向湖北省慈善总会抗洪救灾捐款	1,000.00
2016 年度	“一司一县”捐款	2,120,000.00
2017 年度	“五四”活动慰问关爱老人	650.20
2017 年度	见义勇为基金捐款	500,000.00
2017 年度	救助困难群众捐款	269,265.40

2017 年度	捐赠（“一司一县”帮扶）	1,200,000.00
2017 年度	捐资助学款	6,000.00
2017 年度	贫困区帮扶款	4,538,585.33
2017 年度	松潘县扶贫助学资金	290,800.00
2017 年度	支部送温暖	2,940.00
	合计	12,623,980.93

### (三) 其他事项

- 1、2015 年本公司通过纳入合并范围结构化主体购入上海云峰（集团）有限公司（以下简称云峰集团）非公开发行的定向债务融资工具即“15 云峰 PPN001”债券 4995 万元，票面价值为 5000 万元，记入“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”科目核算。上述债券发行日 2015 年 1 月 23 日，到期日 2017 年 1 月 22 日，票面利率 8%。2017 年 1 月 22 日云峰集团发布公告：由于受能源主产业市场低迷，导致云峰集团财务状况恶化，资金流动性紧张，同时云峰集团实际控制人绿地控股集团有限公司解除与云峰集团托管关系，引起金融机构挤兑。截至 2017 年 1 月 22 日云峰集团未能筹措足额偿债资金，不能按期偿付“15 云峰 PPN001”到期本息债务。根据云峰集团经营状况和谨慎性原则，本公司报告期内已于 2016 年 12 月 31 日和 2017 年 12 月 31 日将持有的“15 云峰 PPN001”债券估值为零，同时全额计提应收利息坏账准备 400 万元。
- 2、根据 2017 年宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司和南京巨石金川股权投资基金管理有限公司股东会决议，宁夏巨石西部股权投资基金管理有限公司和南京巨石金川股权投资基金管理有限公司将自主清算，截止 2017 年 12 月 31 日，上述公司自主清算工作尚未完成。

## 十四、影响本公司经营活动的各项风险因素分析及其对策

报告期内，公司依照监管部门和行业协会全面风险管理规范要求，不断加强日常风险监控，建立了适应公司创新发展要求的全面风险管理体系，确保对公司各类业务风险的识别和可控，为业务的创新和公司稳健发展提供保证。

按照关联性和重要性原则，公司面临的风险因素主要包括：市场风险、信用风险、业务操作风险、流动性风险等方面。

### 1、 风险管理架构

根据监管部门要求，公司设立了首席风险官，建立了适应现代创新发展要求的全面风险管理组织架构。该架构由五个层级构成，分别为：公司董事会及其下设的合规与风险管理委员会；总裁室及其下设的风险控制委员会；首席风险官；风险管理部、合规管理部、计划财务部、稽核部门、办公室等后台管理部门；各业务部门、分支机构及其内设风控合规专

员, 子公司及其风险管理负责人。

首席风险官负责推动公司全面风险管理工作, 指导、协调风险管理部及相关后台职能部门、业务部门和分支机构及子公司的风险管理工作, 组织实施对公司各项业务及整体所面临各类风险的监测、评估、管理、控制与报告工作, 为公司董事会、经营管理层战略发展与业务决策提供风险管理建议和意见, 指导、督促和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

公司确立了风险管理的三道防线: 各部门、分支机构及子公司实施有效的风险管理自我控制为第一道防线; 风险管理部门实施专业的风险管理工作为第二道防线; 稽核部门实施事后监督与评价为第三道防线。

## 2、 市场风险分析及其对策

公司面临的市场风险是公司的持仓组合由于相关市场的不利变化而导致损失的风险。主要源于权益类投资、固定收益类投资、衍生品投资等, 主要集中于公司投资管理总部、金融衍生品部、固定收益总部和资产管理总部等业务部门。

目前, 公司主要从风险评估、投资决策、流程控制、风险隔离四个方面来控制公司的市场风险:

- (1) 风险评估: 公司采取敏感性分析和压力测试等方式, 定期或不定期对公司的市场风险承受能力进行测试, 确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。公司建立了市场风险管理体系, 对收益率曲线风险、期权性风险、股票价格风险等市场风险进行有效识别;
- (2) 投资决策: 公司分别设立证券投资决策委员会、固定收益投资决策委员会和资产管理业务投资决策委员会, 各投资决策委员会对公司总裁室负责, 负责制定公司业务投资策略, 确定证券投资持仓比例及资产配置方案等;
- (3) 流程控制: 公司采取规模控制、授权管理和止盈止损控制等措施来控制市场风险: 公司董事会每年根据风险评估的结果确定自营、固定收益等业务的年度投资规模, 确保在风险可承受的范围内开展业务; 公司董事会对投资决策委员会、投资业务部门按照投资规模、投资范围分级授权, 并且在投资策略、投资具体品种的决策方面相分离, 确保业务各环节的有效制衡; 公司通过止盈止损控制单项投资的风险, 避免单项投资亏损过大情况的出现, 同时通过设定总的风险容忍度来规避系统性市场风险;
- (4) 风险隔离: 公司通过建立隔离墙制度, 对各项业务实施人员、信息、物理、财务、账户等方面的隔离, 防止某项业务的市场风险蔓延到公司其他业务模块, 防止利益冲突或不正当利益输送。

此外, 公司风险管理部通过考虑各类业务投资的风险收益情况, 制定了各类业务的风险限额、风险容忍度系列指标, 使用专业风险管理工具对各类业务的市场风险状况进行独立的监控、测量和管理。当发生接近或超过风险限额情况时, 风险管理部及时向相关部门及领导发送预



警或风险提示，协助并监督业务部门实施应对措施。

(1) 风险价值 (VaR)

报告期末合并口径的自营投资业务按风险类型分别计量的风险价值 (VaR) 如下：

风险来源：	单日 95% VaR (单位：万元人民币)	
	期末金额	年初金额
权益类市场风险	998	624
利率类市场风险	487	821
分散化收益	-203	-135
合计	1,282	1,310

(2) 利率敏感性分析

公司使用利率敏感性分析衡量在假设其他变量不变的情况下，可能发生的合理利率变动对公司收入和权益的影响。

假设市场整体利率平行变动时，公司的利率敏感性分析如下：

	利率敏感性分析 (单位：万元人民币)	
	期末金额	年初金额
权益类市场风险	-1,921.15	-1,018.85
利率类市场风险	1,921.15	1,018.85

3、 信用风险分析及其对策

公司面临的信用风险是指借款人或交易对手未能履行约定契约中的义务而造成经济损失的风险，主要来自融资融券类业务、股票质押回购交易、约定式购回交易、经纪业务代理客户买卖证券、固定收益投资、合同履行等方面。

公司主要采取加强客户征信管理、加强固定收益投资控制及强化合同管理等方式控制信用风险：

- (1) 融资融券业务中，在加强客户征信管理的同时建立了单一客户授信额度、单一担保证券规模等业务信用风险限额，以及逆周期对客户融资保证金比例和担保证券折算率的动态调整机制，确保了自融资融券业务开展以来未发生过重大风险事件的稳健状态。
- (2) 股票质押回购和约定式购回交易中，公司制定有标准化的业务交易协议，明确交易双方的权利义务以及违约处理措施；建立对单一客户、单一证券交易规模的控制，对客户资信、担保品等进行审慎评估并动态管理，落实盯市和担保品追加机制，以有效规避业务信用风险。
- (3) 经纪业务代理客户买卖证券中，公司建立证券交易实时监控系統，对客户异常交易行为、证券账户异常行为、新股上市初期异常交易行为等进行实时监控，对监控系统显示的实时预警指标和查询类指标，区分重要程度及时逐级妥善处理。
- (4) 固定收益投资中，选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易

对手进行交易，减少不良交易对手产生的风险；对债券的发行人及其担保人的资产实力进行分析，跟踪研究发行人的偿债能力，规避兑付风险。

(5) 公司在合同订立的过程中严格贯彻公司的有关制度，实行分级审批，加强法律和合规审核，防止欺诈或不公平条款产生的合同风险。

报告期末，不考虑任何担保物及其他信用增级措施，公司包含客户货币类资产的最大信用风险敞口如下：

(1) 合并口径

项目	期末余额	年初余额
货币资金	6,234,345,394.63	8,830,132,770.93
其中：客户存款	5,652,875,221.68	7,623,024,609.24
结算备付金	1,902,489,618.86	2,304,721,979.31
其中：客户备付金	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
拆出资金		
融出资金	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(注 1)	1,666,103,967.77	1,851,903,688.36
衍生金融资产		
买入返售金融资产	3,489,334,761.40	3,733,511,978.64
应收款项	5,483,767.31	6,771,393.56
应收利息	173,612,883.56	175,766,718.01
划分为持有待售的资产		
存出保证金	326,324,109.59	390,655,953.63
可供出售金融资产(注 2)	1,933,098,890.76	595,018,353.32
最大信用风险敞口	21,302,518,627.46	23,407,410,009.46

注 1：以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产中的信用风险敞口包括债券、银行理财产品以及其他信用类资产。

注 2：可供出售金融资产中的信用风险敞口包括债券、信托计划等资产。

(2) 母公司

项目	期末余额	年初余额
货币资金	5,699,497,247.63	8,205,012,195.04
其中：客户存款	5,196,965,163.15	7,074,541,421.68
结算备付金	1,923,241,896.63	2,373,518,396.72
其中：客户备付金	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
拆出资金		
融出资金	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（注 1）	1,347,938,257.02	1,097,217,358.90
衍生金融资产		
买入返售金融资产	3,386,154,097.60	3,667,811,978.64

项目	期末余额	年初余额
应收款项	6,124,625.65	9,816,176.34
应收利息	159,438,610.00	155,112,189.11
划分为持有待售的资产		
存出保证金	9,952,565.11	7,941,490.73
可供出售金融资产	1,950,990,978.45	584,505,386.25
最大信用风险敞口	20,055,063,511.67	21,619,862,345.43

注 1：以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产中的信用风险敞口包括债券、银行理财产品以及其他信用类资产。

注 2：可供出售金融资产中的信用风险敞口包括债券、信托计划等资产。

公司在融资融券、股票质押、约定式回购业务的信用风险敞口如下：

业务类别	期末余额	年初余额
融资融券业务	5,588,531,465.70	5,535,600,935.03
股票质押业务	2,284,062,941.08	880,256,800.00
约定购回业务		

#### 4、 业务操作风险分析及其对策

业务操作风险是指各项业务因经营模式选择不当或操作失误对公司造成的风险，如操作流程设计不当或矛盾，内部控制未落实等。

业务操作风险涉及公司各项业务，包括经纪业务、自营业务、资产管理业务、投资银行业务等，公司主要通过下列措施控制操作风险：

- (1) 建立并完善各项业务制度、操作流程和对应的业务表单，明确各业务的操作规范。
- (2) 公司专门制定了操作风险管理制度，对公司业务开展中各类操作风险的识别、评估、防范和控制作了明确的规定和要求，进一步强化了各类别操作风险的管理。
- (3) 明确界定各部门、分支机构及不同工作岗位职责和权限，体现重要部门、关键岗位之间分离、制衡及相互监督的原则。
- (4) 建立健全授权管理制度，明确授权的范围、方式、权限、时效和责任，并建立相应的授权反馈和修正机制，确保授权管理的有效落实。
- (5) 及时做好创新业务风险的识别与控制，通过制度先行措施规范业务操作流程。
- (6) 建立内部控制管理学习培训体系，组织各项内控制度的培训，加强员工职业道德教育。

#### 5、 流动性风险分析及其对策

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

公司主要通过完善财务资金管理制度、建立净资本预警机制、动态监控等措施控制流动性风险：

- (1) 建立健全以净资产为核心的风险控制指标预警机制，严格按照监管部门风险控制指标规定比例开展有关业务，确保风险控制指标及有关财务指标持续符合相关监管规定。
  - (2) 建立健全财务管理制度和资金管理制度，实行全面预算管理制度，健全财务指标考核体系；严格执行资金调拨、资金运用的授权审批制度，加强资金筹集的计划管理。
  - (3) 公司积极开展资金缺口管理，通过测算现金流量缺口，有效管理支付风险。
  - (4) 公司拓展多元化的融资渠道，避免由于融资渠道过于集中或融资方式过于单一而导致的筹资困难。
  - (5) 公司建立了流动性风险指标动态监控系统，做到实时监控和防范公司流动性风险。
- 于资产负债表日，本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：

南京证券股份有限公司  
2017 年度  
财务报表附注

项目	期末余额							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	
应付短期融资款	825,000.00	15,640,479.45	340,835,153.57	1,366,979,870.82				1,724,280,503.84
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								
卖出回购金融资产款		2,364,352,454.83						2,364,352,454.83
代理买卖证券款	7,052,225,490.04							7,052,225,490.04
代理承销证券款	953,688.33							953,688.33
应付款项	7,033,953.89							7,033,953.89
预计负债	541,766.60							541,766.60
应付债券				798,736,438.34	1,195,200,000.00			1,993,936,438.34
其他负债	129,466,680.99	66,131,536.20	-	317,054,151.74	2,758,883.26	-	-	515,411,252.19
合计	7,191,046,579.85	2,446,124,470.48	340,835,153.57	2,482,770,460.90	1,197,958,883.26	-	-	13,658,735,548.06

项目	年初余额							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	
应付短期融资款		57,720,060.00						57,720,060.00
拆入资金		2,427,068,172.83	197,528,591.50					2,624,596,764.33
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	9,358,238,245.28							9,358,238,245.28
卖出回购金融资产款	108,297.15							108,297.15
代理买卖证券款	7,401,869.37							7,401,869.37
代理承销证券款								
应付款项			1,010,161,111.11	2,749,507,222.52	740,600,000.00	-		4,500,268,333.63
预计负债	160,022,876.16	23,922,973.37	566,068.86	560,431,576.79	44,299,155.25	178,803,859.59		968,046,510.02
合计	9,525,771,287.96	2,508,711,206.20	1,208,255,771.47	3,309,938,799.31	784,899,155.25	178,803,859.59		17,516,380,079.78

## 十五、金融资产和金融负债的公允价值管理

### (一) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

具有标准条款及条件并存在活跃市场的金融资产及金融负债的公允价值分别按照相应的活跃市场现行出价及现行要价确定；其他金融资产及金融负债（不包括衍生工具）的公允价值按照未来现金流量折现法为基础的通用定价模型确定或采用可观察的现行市场交易价格确认；衍生工具的公允价值采用活跃市场的公开报价确定。如果不存在公开报价，不具有选择权的衍生工具的公允价值采用未来现金流量折现法在适用的收益曲线的基础上估计确定；具有选择权的衍生工具的公允价值采用期权定价模型（如二项模型）计算确定。

### (二) 公允价值计量层级

本公司根据以下层级确定及披露金融工具的公允价值：

第一层：集中交易系统挂牌的股票、债券、基金等金融工具作为第一层次公允价值计量项目，其公允价值根据交易场所（或清算机构）公布的收盘价或结算价确定；

第二层：将银行间市场债券、证券公司理财产品、限售股以及场外衍生工具等作为第二层次公允价值计量项目，本公司在确定公允价值时，优先选择权威第三方机构公布的推荐估值，如中国债券登记结算公司提供的债券估值，若无法直接获取权威第三方机构公布的推荐估值，本公司将采用管理人公布的估值、估值模型等估值方法对第二层次公允价值计量项目进行估值；

第三层：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

### (三) 报告期内本公司金融资产按照层级划分情况

#### 1、截至 2017 年 12 月 31 日，合并报表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			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
持续的公允价值计量				
以公允价值计量的金融资产	1,573,470,212.33	2,409,084,722.59	347,414,700.00	4,329,969,634.92
（一）以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	817,629,385.97	1,140,062,110.40	-	1,957,691,496.37
（1）债务工具投资	526,041,857.37	1,133,258,608.28		1,659,300,465.65
（2）权益工具投资	291,587,528.60	6,803,502.12		298,391,030.72
（3）衍生金融资产				
（二）可供出售金融资产	755,840,826.36	1,269,022,612.19	347,414,700.00	2,372,278,138.55
（1）债务工具投资	698,162,435.23	1,234,936,455.53		1,933,098,890.76
（2）权益工具投资	57,678,391.13	34,086,156.66	347,414,700.00	439,179,247.79
（3）其他				
以公允价值计量的金融负债	1,051,600.00			1,051,600.00
（一）以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	1,051,600.00			1,051,600.00

**2、截至 2017 年 12 月 31 日，母公司报表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			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
持续的公允价值计量				
以公允价值计量的金融资产	1,276,704,734.53	2,456,060,966.48	100,190,000.00	3,832,955,701.01
（一）以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	556,273,921.87	1,041,065,799.65		1,597,339,721.52
（1）债务工具投资	306,872,457.37	1,034,286,509.65		1,341,158,967.02
（2）权益工具投资	249,401,464.50	6,779,290.00		256,180,754.50
（3）衍生金融资产				
（二）可供出售金融资产	720,430,812.66	1,414,995,166.83	100,190,000.00	2,235,615,979.49
（1）债务工具投资	662,752,421.53	1,234,936,455.53		1,897,688,877.06
（2）权益工具投资	57,678,391.13	180,058,711.30	100,190,000.00	337,927,102.43
（3）其他				
以公允价值计量的金融负债	1,051,600.00			1,051,600.00
（一）以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	1,051,600.00			1,051,600.00

**(四) 报告期内本公司以公允价值计量的各层级金融工具变动情况**

报告期内本公司以公允价值计量的各层级金融工具未发生变动。

**十六、 母公司财务报表主要项目注释**

**(一) 货币资金**

**1、按照类别列示：**

项目	期末余额	年初余额
现金	13,287.13	29,366.03
银行存款	5,699,483,960.50	8,204,982,829.01
其中：客户存款	5,196,965,163.15	7,074,541,421.68
公司存款	502,518,797.35	1,130,441,407.33
其他货币资金		
合计	5,699,497,247.63	8,205,012,195.04

**2、按照币种列示：**

项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
库存现金			13,287.13
银行存款			5,699,483,960.50
其中：公司自有资金存款			493,298,055.81



项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
公司信用资金存款			9,220,741.54
客户资金存款			4,548,456,792.50
其中：美元	10,614,468.39	6.53420	69,357,059.37
港元	19,956,958.19	0.83591	16,682,220.94
人民币			4,462,417,512.19
客户信用资金存款			648,508,370.65
其中：人民币			648,508,370.65
其他货币资金			
其中：新股申购款			
合计			5,699,497,247.63

项目	年初余额		
	原币	汇率	本币
库存现金			29,366.03
银行存款			8,204,982,829.01
其中：公司自有资金存款			1,118,855,871.71
公司信用资金存款			11,585,535.62
客户资金存款			6,251,604,427.31
其中：美元	11,884,694.28	6.93700	82,444,124.25
港元	18,711,905.94	0.89451	16,737,986.95
人民币			6,152,422,316.11
客户信用资金存款			822,936,994.37
其中：人民币			822,936,994.37
其他货币资金			
其中：新股申购款			
合计			8,205,012,195.04

3、 期末本公司货币资金余额中无抵押、质押、冻结等有限制流动及潜在回收风险的款项。

## (二) 结算备付金

### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
客户备付金	1,704,055,462.79	2,099,637,553.74
公司备付金	219,186,433.84	273,880,842.98
合计	1,923,241,896.63	2,373,518,396.72

### 2、 按照币种列示：

项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
公司自有备付金			219,186,433.84

项目	期末余额		
	原币	汇率	本币
其中：人民币			219,186,433.84
公司信用备付金			
其中：人民币			
公司备付金合计			219,186,433.84
客户普通备付金			1,400,885,002.49
其中：美元	2,577,337.35	6.53420	16,840,837.71
港币	6,875,624.61	0.83591	5,747,403.37
人民币			1,378,296,761.41
客户信用备付金			303,170,460.30
其中：人民币			303,170,460.30
客户备付金合计			1,704,055,462.79
合计			1,923,241,896.63

项目	年初余额		
	原币	汇率	本币
公司自有备付金			273,880,842.98
其中：人民币			273,880,842.98
公司信用备付金			
其中：人民币			
公司备付金合计			273,880,842.98
客户普通备付金			1,707,651,213.80
其中：美元	2,269,431.18	6.93700	15,743,044.09
港币	9,374,210.88	0.89451	8,385,325.36
人民币			1,683,522,844.35
客户信用备付金			391,986,339.94
其中：人民币			391,986,339.94
客户备付金合计			2,099,637,553.74
合计			2,373,518,396.72

3、 期末本公司结算备付金余额中无抵押、质押、冻结等有限制流动及潜在回收风险的款项。

### (三) 融出资金

#### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
融资融券业务融出资金	5,588,490,705.70	5,535,533,775.03
孖展融资		
减：减值准备	16,765,472.12	16,606,601.33
融出资金净值	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70

#### 2、 按照客户类别列示：

项目	期末余额	年初余额
个人	5,588,490,705.70	5,535,533,775.03
机构		
减：减值准备	16,765,472.12	16,606,601.33
融出资金净值	5,571,725,233.58	5,518,927,173.70

### 3、按照账龄分析：

账龄	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例（%）	坏账准备	比例（%）
1-3 个月	2,855,356,276.10	51.09	8,566,068.83	0.30
3-6 个月	1,219,962,249.26	21.83	3,659,886.75	0.30
6-12 个月	445,767,855.20	7.98	1,337,303.56	0.30
1 年以上	1,067,404,325.14	19.10	3,202,212.98	0.30
合计	5,588,490,705.70	100.00	16,765,472.12	

账龄	年初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例（%）	坏账准备	比例（%）
1-3 个月	3,593,724,771.24	64.93	10,781,174.31	0.30
3-6 个月	673,744,432.57	12.17	2,021,233.30	0.30
6-12 个月	228,856,706.84	4.13	686,570.12	0.30
1 年以上	1,039,207,864.38	18.77	3,117,623.60	0.30
合计	5,535,533,775.03	100.00	16,606,601.33	

### 4、融资融券对应的担保物信息：

项目	期末余额	年初余额
货币资金	697,896,724.20	889,344,884.24
债券	7,965,566.81	1,124,762.29
基金	26,922,359.43	25,660,820.96
股票	16,217,892,876.12	16,977,020,083.53
合计	16,950,677,526.56	17,893,150,551.02

2017 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 558,853.15 万元，其中：融出资金余额 558,849.07 万元，融出证券余额 4.08 万元，担保物公允价值金额合计为 1,695,067.75 万元；2016 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 553,560.10 万元，其中：融出资金余额 553,553.38 万元，融出证券余额 6.72 万元，担保物公允价值金额合计为 1,789,315.06 万元。

### 5、期末融出资金逾期及其对应担保物金额：

截至 2017 年 12 月 31 日，本公司一位客户融出资金逾期平仓后未偿还，未偿还余额已转入

应收款项并全额计提坏账准备。

- 6、 期内本公司将上述融资融券业务中的部分债权收益权进行了质押式回购，详见附注十六-（十一）。

(四) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

1、 按照明细列示：

项目	期末余额	
	账面余额	初始成本
为交易目的而持有的金融资产		
其中：股票	249,401,464.50	224,604,615.37
债券	1,341,158,967.02	1,345,939,088.46
基金	6,779,290.00	6,706,767.56
合计	1,597,339,721.52	1,577,250,471.39

项目	年初余额	
	账面余额	初始成本
为交易目的而持有的金融资产		
其中：股票	340,911,308.66	344,934,420.02
债券	1,088,993,666.55	1,098,517,515.22
基金	8,223,692.35	8,657,874.43
合计	1,438,128,667.56	1,452,109,809.67

2、 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	期末余额	年初余额
正回购业务质押标的物	891,343,850.00	651,978,967.01
转融通拆入资金质押标的物		
合计	891,343,850.00	651,978,967.01

- 3、 期末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。

(五) 衍生金融工具

类别	期末余额					
	名义金额	套期工具		名义金额	非套期工具	
		公允价值	公允价值		公允价值	公允价值
		资产	负债		资产	负债
股权类衍生工具						
其中：股指期货[注 1]						
权益互换						
股指期权						
场外期权						

类别	期末余额					
	名义金额	套期工具		名义金额	非套期工具	
		公允价值			公允价值	
	资产	负债	资产	负债		
利率衍生工具						
其中：国债期货						
利率互换						
其他衍生工具				124,453,715.00		1,051,600.00
其中：商品期货[注 2]				11,791,115.00		-
商品期权[注 3]				112,662,600.00		1,051,600.00
远期合约						
合计				124,453,715.00		1,051,600.00

类别	年初余额					
	名义金额	套期工具		名义金额	非套期工具	
		公允价值			公允价值	
	资产	负债	资产	负债		
股权类衍生工具				24,591,200.00		
其中：股指期货[注 1]				24,591,200.00		
权益互换						
利率衍生工具						
其中：利率互换						
其他衍生工具						
其中：期权						
合计				24,591,200.00		

注 1:

2016 年 12 月 31 日本公司持有的股指期货合约 24 手，其中：看跌合约 24 手，初始合约价值为 24,591,200.00 元，公允价值变动-222,080.00 元。

注 2:

2017 年 12 月 31 月本公司持有的商品期货合约 348 手，其中：看涨合约 79 手，初始合约价值为 3,433,595.00 元，公允价值变动-96,700.00 元；看跌合约 269 手，初始合约价值 8,357,520.00 元，公允价值变动 79,860.00 元。

注 3:

2017 年 12 月 31 日本公司持有商品期权合约 4000 手，其中卖出商品期权合约 4000 手，收取期权费 1,227,435.18 元，公允价值变动 175,835.18 元。

由于期货类业务采用当日无负债结算制度，期货业务结算备付金已包括本公司于 2017 年 12 月 31

日、2016 年 12 月 31 日所持有的期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币 0 元。

## (六) 买入返售金融资产

### 1、 按照标的物类别列示：

标的物类别	期末余额	年初余额
股票	2,284,062,941.08	880,256,800.00
债券	1,108,943,345.34	2,790,195,949.04
其中：国债	350,200,000.00	349,100,000.00
中期票据	251,400,000.00	
定向工具	70,000,000.00	
同业存单		
金融债	50,610,712.33	1,058,879,567.37
公司债	386,732,633.01	1,382,216,381.67
减：减值准备	6,852,188.82	2,640,770.40
合计	3,386,154,097.60	3,667,811,978.64

### 2、 按照业务类别：

项目	期末余额	年初余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	2,284,062,941.08	880,256,800.00
其他债券回购业务	1,108,943,345.34	2,790,195,949.04
减：减值准备	6,852,188.82	2,640,770.40
合计	3,386,154,097.60	3,667,811,978.64

### 3、 报告期期末买入返售金融资产剩余期限

#### (1) 股票质押式回购剩余期限：

期限	期末余额	年初余额
1 个月内	144,693,128.76	14,280,000.00
1 个月至 3 个月内	371,589,933.88	190,500,000.00
3 个月至 1 年内	1,318,019,878.44	564,076,800.00
1 年以上	449,760,000.00	111,400,000.00
合计	2,284,062,941.08	880,256,800.00

#### (2) 其他债券回购业务融出资金剩余期限：

期限	期末余额	年初余额
1 个月内	1,108,943,345.34	2,542,880,255.90
1 个月至 3 个月内		197,091,220.54
3 个月至 1 年内		50,224,472.60
1 年以上		
合计	1,108,943,345.34	2,790,195,949.04

**4、 买入返售金融资产的担保物信息:**

类别	期末余额	年初余额
股票	5,363,411,743.52	3,020,470,281.79
债券	1,220,603,893.80	2,806,768,876.50
合计	6,584,015,637.32	5,827,239,158.29

**5、 期末买入返售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物，期末公允价值为 32,920.75 万元，质押到期日为 2018 年 1 月 2 日和 2018 年 1 月 4 日。**

**(七) 应收利息**

项目	期末余额	年初余额
存款利息	10,110,309.08	13,324,175.17
债券利息	60,094,457.16	62,783,849.79
买入返售金融资产利息	6,243,338.19	5,121,485.63
融资融券业务利息	80,183,377.87	67,050,226.74
约定购回式业务利息		
股票质押式回购业务利息	2,807,127.70	6,832,451.78
合计	159,438,610.00	155,112,189.11

**(八) 可供出售金融资产**

**1、 可供出售金融资产情况:**

项目	期末余额		
	账面余额	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	1,897,688,877.06		1,897,688,877.06
可供出售权益工具	436,927,102.43		436,927,102.43
合计	2,334,615,979.49		2,334,615,979.49

项目	年初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值
可供出售债务工具	565,018,353.32		565,018,353.32
可供出售权益工具	1,814,478,800.42		1,814,478,800.42
合计	2,379,497,153.74		2,379,497,153.74

**2、 按照金融资产品种列示:**

项目	期末余额			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
股票	13,889,701.77	9,248,861.76		23,138,563.53
债券	1,922,798,063.16	-25,109,186.10		1,897,688,877.06
基金	54,822,886.38	3,104,484.02		57,927,370.40
资产管理计划	106,009,822.52	-2,450,755.41		103,559,067.11

信托计划	50,000,000.00	3,302,101.39		53,302,101.39
收益互换产品				
银行理财产品	100,000,000.00			100,000,000.00
其他权益投资[注]	99,000,000.00			99,000,000.00
合计	2,346,520,473.83	-11,904,494.34		2,334,615,979.49

项目	年初余额			账面价值
	初始成本	公允价值变动	减值准备	
股票	11,404,288.77	9,780,483.98		21,184,772.75
债券	544,343,410.74	20,674,942.58		565,018,353.32
基金	79,632,717.60	1,248,244.10		80,880,961.70
资产管理计划	136,459,822.52	3,025,458.57		139,485,281.09
信托计划	19,000,000.00	487,032.93		19,487,032.93
收益互换产品	1,144,830,000.00	9,610,751.95		1,154,440,751.95
银行理财产品	300,000,000.00			300,000,000.00
其他权益投资[注]	99,000,000.00			99,000,000.00
合计	2,334,670,239.63	44,826,914.11		2,379,497,153.74

【注】权益工具系不具有控制、共同控制或重大影响的股权投资，明细列示如下：

被投资单位	持股比例(%)	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
江苏股权交易中心	12.00	24,000,000.00			24,000,000.00
中证机构间报价系统股份有限公司	0.66	50,000,000.00			50,000,000.00
证通股份有限公司	0.99	25,000,000.00			25,000,000.00
合计		99,000,000.00			99,000,000.00

### 3、 期末按公允价值计量的可供出售金融资产：

可供出售金融资产分类	期末余额		
	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/债务的摊余成本	324,722,410.67	1,922,798,063.16	2,247,520,473.83
公允价值	337,927,102.43	1,897,688,877.06	2,235,615,979.49
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	13,204,691.76	-25,109,186.10	-11,904,494.34
已计提减值金额			

可供出售金融资产分类	年初余额		
	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/债务的摊余成本	1,691,326,828.89	544,343,410.74	2,235,670,239.63
公允价值	1,715,478,800.42	565,018,353.32	2,280,497,153.74
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	24,151,971.53	20,674,942.58	44,826,914.11
已计提减值金额			

### 4、 融券业务开展情况：



项目	期末余额	年初余额
融出证券		
—可供出售金融资产	40,760.00	67,160.00
—转融通融入证券		
合计	40,760.00	67,160.00

本期融券业务无违约情况。

#### 5、 融资融券担保物信息：

项目	期末余额	年初余额
货币资金	697,896,724.20	889,344,884.24
债券	7,965,566.81	1,124,762.29
基金	26,922,359.43	25,660,820.96
股票	16,217,892,876.12	16,977,020,083.53
合计	16,950,677,526.56	17,893,150,551.02

2017 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 558,853.15 万元，其中：融出资金余额 558,849.07 万元，融出证券余额 4.08 万元，担保物公允价值金额合计为 1,695,067.75 万元；2016 年 12 月 31 日本公司融资融券余额为 553,560.10 万元，其中：融出资金余额 553,553.38 万元，融出证券余额 6.72 万元，担保物公允价值金额合计为 1,789,315.06 万元。

#### 6、 变现受到限制的可供出售金融资产：

项目	期末余额	年初余额
资产管理计划	103,559,067.11	51,028,040.63
信托计划	53,302,101.39	19,487,032.93
质押式正回购业务	1,097,880,784.61	482,043,517.70
买断式正回购业务	147,241,810.00	
融出证券	40,760.00	67,160.00
合计	1,402,024,523.11	552,625,751.26

资产管理计划系本公司以管理人身份认购的本公司发行的集合资产管理计划份额，以及本公司通过购买资产管理计划投资金融产品次级部分；信托计划系本公司购买信托计划次级份额。

- 7、 报告期内收益互换产品为本公司参与投资于中国证券金融股份有限公司专户。根据相关合约，本公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险、分享投资收益。

### (九) 长期股权投资

#### 1、 按照类别列示：

项目	期末余额	年初余额
联营企业投资	215,543,852.93	97,581,710.02
子公司投资	481,050,000.00	481,050,000.00

合计	696,593,852.93	578,631,710.02
长期投资减值准备		
长期股权投资净值	696,593,852.93	578,631,710.02

## 2、 被投资单位明细：

被投资单位	核算方法	投资成本	年初余额	增减变动	期末余额
富安达基金管理 有限公司	权益法	251,370,000.00	97,581,710.02	117,962,142.91	215,543,852.93
权益法小计		251,370,000.00	97,581,710.02	117,962,142.91	215,543,852.93
南证期货有限 责任公司	成本法	150,450,000.00	150,450,000.00		150,450,000.00
南京巨石创业 投资有限公司	成本法	300,000,000.00	300,000,000.00		300,000,000.00
宁夏股权托管 交易中心（有 限公司）	成本法	30,600,000.00	30,600,000.00		30,600,000.00
成本法小计		481,050,000.00	481,050,000.00		481,050,000.00
合计		732,420,000.00	578,631,710.02	117,962,142.91	696,593,852.93

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
49.00	49.00				
100.00	100.00				
100.00	100.00				
51.00	51.00				

3、 权益法核算联营企业相关信息，详见：附注八：在其他主体中的权益之（三）。

4、 期末本公司长期股权投资未出现减值的情况，无需计提减值准备。

5、 联营企业的重要会计政策与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

## (十) 应付短期融资款

### 1、 按照类别列示：

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
固定收益凭证		1,680,010,000.00	16,100,000.00	1,663,910,000.00
合计		1,680,010,000.00	16,100,000.00	1,663,910,000.00

### 2、 短期固定收益凭证明细：

名称	起息日	到期日	收益率（%）

快乐阳光 364 天 5 号 2 期 SP5827	2017 年 4 月 13 日	2018 年 4 月 12 日	4.85
快乐阳光 365 天 5 号 3 期 SQ1788	2017 年 4 月 26 日	2018 年 4 月 26 日	4.60
快乐阳光 364 天收益凭证 5 号 4 期	2017 年 5 月 11 日	2018 年 5 月 10 日	4.90
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 5 期	2017 年 5 月 16 日	2018 年 5 月 16 日	4.90
快乐阳光 363 天收益凭证 5 号 6 期	2017 年 5 月 19 日	2018 年 5 月 17 日	5.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 7 期	2017 年 5 月 23 日	2018 年 5 月 23 日	5.00
快乐阳光 280 天收益凭证 4 号 2 期	2017 年 5 月 24 日	2018 年 2 月 27 日	4.90
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 8 期	2017 年 6 月 13 日	2018 年 6 月 13 日	5.30
快乐阳光 180 天收益凭证 1 号 15 期	2017 年 8 月 17 日	2018 年 2 月 13 日	5.10
鑫享 1 号 1 期 14 天固定收益凭证	2017 年 9 月 27 日	2017 年 10 月 11 日	6.66
鑫享 1 号 2 期 14 天固定收益凭证	2017 年 9 月 29 日	2017 年 10 月 13 日	6.66
鑫享 1 号 3 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 11 日	2017 年 10 月 25 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 3 期	2017 年 10 月 12 日	2018 年 1 月 10 日	5.00
鑫享 1 号 4 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 13 日	2017 年 10 月 27 日	6.66
鑫享 1 号 5 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 18 日	2017 年 11 月 1 日	6.66
鑫享 1 号 6 期 14 天固定收益凭证	2017 年 10 月 25 日	2017 年 11 月 8 日	6.66
鑫享 1 号 7 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 1 日	2017 年 11 月 15 日	6.66
鑫享 1 号 8 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 8 日	2017 年 11 月 22 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 4 期	2017 年 11 月 9 日	2018 年 2 月 7 日	5.10
鑫享 1 号 9 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 15 日	2017 年 11 月 29 日	6.66
鑫享 1 号 10 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 22 日	2017 年 12 月 6 日	6.66
鑫享 1 号 11 期 14 天固定收益凭证	2017 年 11 月 29 日	2017 年 12 月 13 日	6.66
鑫享 1 号 12 期 14 天固定收益凭证	2017 年 12 月 6 日	2017 年 12 月 20 日	6.66
鑫享 1 号 13 期 14 天固定收益凭证	2017 年 12 月 13 日	2017 年 12 月 27 日	6.66
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 5 期	2017 年 12 月 14 日	2018 年 3 月 14 日	5.15

(续上表)

名称	年初余额	本期发行	本期偿还	期末余额
快乐阳光 364 天 5 号 2 期 SP5827		500,000,000.00		500,000,000.00
快乐阳光 365 天 5 号 3 期 SQ1788		59,270,000.00		59,270,000.00
快乐阳光 364 天收益凭证 5 号 4 期		46,950,000.00		46,950,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 5 期		49,910,000.00		49,910,000.00
快乐阳光 363 天收益凭证 5 号 6 期		37,060,000.00		37,060,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 7 期		26,040,000.00		26,040,000.00
快乐阳光 280 天收益凭证 4 号 2 期		300,000,000.00		300,000,000.00
快乐阳光 365 天收益凭证 5 号 8 期		300,000,000.00		300,000,000.00
快乐阳光 180 天收益凭证 1 号 15 期		300,000,000.00		300,000,000.00
鑫享 1 号 1 期 14 天固定收益凭证		1,200,000.00	1,200,000.00	-
鑫享 1 号 2 期 14 天固定收益凭证		1,900,000.00	1,900,000.00	-
鑫享 1 号 3 期 14 天固定收益凭证		1,750,000.00	1,750,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 3 期		15,450,000.00		15,450,000.00
鑫享 1 号 4 期 14 天固定收益凭证		2,250,000.00	2,250,000.00	-
鑫享 1 号 5 期 14 天固定收益凭证		1,100,000.00	1,100,000.00	-
鑫享 1 号 6 期 14 天固定收益凭证		900,000.00	900,000.00	-

鑫享 1 号 7 期 14 天固定收益凭证		950,000.00	950,000.00	-
鑫享 1 号 8 期 14 天固定收益凭证		1,050,000.00	1,050,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 4 期		20,000,000.00		20,000,000.00
鑫享 1 号 9 期 14 天固定收益凭证		850,000.00	850,000.00	-
鑫享 1 号 10 期 14 天固定收益凭证		1,450,000.00	1,450,000.00	-
鑫享 1 号 11 期 14 天固定收益凭证		1,050,000.00	1,050,000.00	-
鑫享 1 号 12 期 14 天固定收益凭证		750,000.00	750,000.00	-
鑫享 1 号 13 期 14 天固定收益凭证		900,000.00	900,000.00	-
快乐阳光 90 天固定收益凭证 2 号 5 期		9,230,000.00		9,230,000.00
合计		1,680,010,000.00	16,100,000.00	1,663,910,000.00

- 3、 根据中国证券业协会发布的《证券公司柜台市场管理办法（试行）》及《机构间私募产品报价与服务系统管理办法（试行）》的通知（中证协发【2014】137 号），本公司于 2014 年 9 月开始发行收益凭证。

(十一) 卖出回购金融资产款

1、 按照金融资产类别列示：

项目	期末余额	年初余额
债券	2,359,381,144.71	2,621,608,266.12
融资融券收益权	500,000,000.00	
质押式报价回购		
合计	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12

2、 按照标的物类别列示：

项目	期末余额	年初余额
国债	300,000,000.00	160,956,000.00
金融债		765,112,320.84
同业存单	802,358,391.29	
短期融资券	99,000,000.00	220,138,767.12
中期票据	405,381,260.27	594,781,967.21
公司债	752,641,493.15	880,619,210.95
融资融券收益权	500,000,000.00	
合计	2,859,381,144.71	2,621,608,266.12

3、 质押式回购融入资金按照剩余期限列示：

期限	期末余额	利率区间（%）
1 个月内	1,709,530,000.00	4.50-20.00
1 个月至 3 个月内		
合计	1,709,530,000.00	

期限	年初余额	利率区间（%）

1 个月内	1,445,261,000.00	3.10-5.40
1 个月至 3 个月内		
合计	1,445,261,000.00	

**4、 买断式回购融入资金按照剩余期限列示：**

期限	期末余额	利率区间（%）
1 个月内	649,851,144.71	4.00-11.00
1 个月至 3 个月内		
合计	649,851,144.71	

期限	年初余额	利率区间（%）
1 个月内	979,256,045.58	2.50-5.10
1 个月至 3 个月内	197,091,220.54	4.50
合计	1,176,347,266.12	

**5、 卖出回购金融资产款担保物信息列示：**

项目	标的物类别	期末余额	年初余额
债券质押式回购	债券	1,799,811,084.61	1,561,969,164.15
债券买断式回购	债券	665,862,840.00	1,160,643,510.00
融资融券收益权转让借款	融资融券收益权	545,772,214.57	
合计		3,011,446,139.18	2,722,612,674.15

**(十二) 代理买卖证券款**

**1、 代理买卖证券款按客户类别列示：**

项目	期末余额	年初余额
普通经纪业务：	5,837,954,381.47	7,847,333,014.39
个人客户	5,608,130,944.37	7,585,970,795.24
机构客户	229,823,437.10	261,362,219.15
信用业务：	648,508,370.66	822,936,994.37
个人客户	648,508,370.66	822,936,994.37
机构客户		
合计	6,486,462,752.13	8,670,270,008.76
个人客户	6,256,639,315.03	8,408,907,789.61
机构客户	229,823,437.10	261,362,219.15

**2、 代理买卖证券款按币种类别列示：**

项目	期末余额		
	原币	汇率	(折)人民币
人民币			6,405,165,487.09
美元	9,876,377.72	6.53420	64,534,227.28
港币	20,053,639.44	0.83591	16,763,037.76
合计			6,486,462,752.13

项目	年初余额		
	原币	汇率	(折)人民币
人民币			8,575,374,843.09
美元	10,909,396.18	6.93700	75,678,481.32
港币	21,482,917.29	0.89451	19,216,684.35
合计			8,670,270,008.76

### (十三) 应付债券

#### 1、按照类别列示:

项目	年初余额	本期增加	本期减少	期末余额
次级债	3,000,000,000.00		2,300,000,000.00	700,000,000.00
非公开发行公司债第一期	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	
公开发行公司债券		997,179,834.23		997,179,834.23
合计	4,200,000,000.00	997,179,834.23	3,500,000,000.00	1,697,179,834.23

#### 2、次级债明细列示:

债券名称	面值	起息日	债券期限	发行金额	年初余额	本期发行
14 南京债	100	2014 年 11 月 19 日	4 年	700,000,000.00	700,000,000.00	
15 南京 02	100	2015 年 4 月 17 日	2 年	1,300,000,000.00	1,300,000,000.00	
15 南京 01	100	2015 年 3 月 3 日	2 年	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	
合计				3,000,000,000.00	3,000,000,000.00	

(续上表)

债券名称	溢折价摊销	本期偿还	期末余额
14 南京债			700,000,000.00
15 南京 02		1,300,000,000.00	
15 南京 01		1,000,000,000.00	
合计		2,300,000,000.00	700,000,000.00

根据第一届董事会第六次会议，并经 2012 年度股东大会会议批准，本公司发行次级债券累计总额不超过 30 亿元。

2014 年本公司发行次级债 7 亿元，采用固定利率形式，票面年利率为 5.80%，并在债券存续期内的前 2 年固定不变。本期债券存续期限的第 2 年末，公司可选择调整票面利率 0 至 100 个基点（含本数），债券票面年利率为债券存续期前 2 年票面年利率加上公司上调的基点，在债券存续期后 2 年固定不变。

2015 年本公司发行 2015 年次级债券（第一期）（简称：15 南京 01）和 2015 年次级债（第二期）（简称：15 南京 02），发行规模分别为 10 亿元和 13 亿元，采用固定利率形式，年利率分别为 5.90%和 6.05%，本期 2015 年次级债券（第一期）（简称：15 南京 01）和 2015 年次级债（第二期）（简称：15 南京 02）已到期兑付。

**3、 非公开发行公司债券明细列示:**

债券名称	面值	起息日	到期日	发行金额
非公开发行公司债券第一期	100	2015 年 6 月 26 日	2017 年 6 月 25 日	1,200,000,000.00
合计				1,200,000,000.00

(续上表)

债券名称	按面值计提利息	年初余额	溢折价摊销	本期偿还	期末余额
非公开发行公司债券第一期	73,200,000.00	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	
合计	73,200,000.00	1,200,000,000.00		1,200,000,000.00	

根据深圳证券交易所《关于南京证券股份有限公司 2015 年非公开发行公司债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函【2015】284 号), 公司获准非公开发行面值不超过 40 亿元人民币的公司债券。本期发行债券采用固定利率形式, 票面利率 6.00%, 本期已到期兑付。

**4、 公开公司债券明细列示:**

债券名称	面值	起息日	到期日	发行金额	初始摊余成本
应付公司债券(17 南京 01)	100	2017/10/24	2022/10/23、 2020/10/23	1,000,000,000.00	997,000,000.00
合计	100			1,000,000,000.00	997,000,000.00

债券名称	按面值计提利息	年初余额	溢折价等摊销	本期偿还	2017 年 12 月 31 日
应付公司债券(17 南京 01)	9,225,205.48		179,834.23		997,179,834.23
合计	9,225,205.48		179,834.23	-	997,179,834.23

根据中国证监会《关于核准南京证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可【2016】2850 号)和上海证券交易所《关于南京证券股份有限公司面向合格投资者公开发行公司债券上市预审核意见的函》(上证债(审)【2016】370 号), 公司获准面向合格投资者公开发行面值不超过 36 亿元人民币公司债券。2017 年公司发行债券票面总额 10 亿元, 采用固定利率形式, 票面利率 4.88%, 发行费用 300 万元, 实际利率 4.99%。本期债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止, 若投资者行使回售权, 则计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2020 年 10 月 23 日止, 未回售部分债券的计息期限自 2017 年 10 月 24 日起至 2022 年 10 月 23 日止。

**5、 根据中国证券业协会发布的《证券公司柜台市场管理办法(试行)》及《机构间私募产品报价与服务系统管理办法(试行)》的通知(中证协发【2014】137 号), 本公司于 2014 年 9 月开始发行收益凭证。**

(十四) 手续费及佣金净收入

1、 按照类别列示:

项目	本期数	上期数
<b>手续费及佣金收入</b>		
<b>1、经纪业务</b>	656,290,020.50	847,409,057.33
<b>其中：证券经纪业务</b>	656,290,020.50	847,409,057.33
其中：代理买卖证券业务	635,473,050.75	824,575,033.14
交易单位席位租赁	5,282,796.58	9,819,158.14
代销金融产品业务	15,534,173.17	13,014,866.05
<b>期货经纪业务</b>		
<b>2、投资银行业务</b>	89,712,952.96	261,051,929.18
其中：证券承销业务	20,389,386.77	170,853,739.10
保荐服务业务	2,730,188.68	14,396,226.42
财务顾问业务	66,593,377.51	75,801,963.66
<b>3、资产管理业务</b>	83,324,496.34	104,711,905.79
<b>4、基金管理业务</b>		
<b>5、投资咨询业务</b>		1,094,369.15
<b>6、股权托管服务业务</b>		
<b>7、其他</b>	723,074.66	96,918.99
<b>手续费及佣金收入合计</b>	<b>830,050,544.46</b>	<b>1,214,364,180.44</b>
<b>手续费及佣金支出：</b>		
<b>1、经纪业务</b>	214,050,973.35	228,845,180.38
<b>其中：证券经纪业务</b>	214,050,973.35	228,845,180.38
其中：代理买卖证券业务	214,050,973.35	228,841,695.93
交易单位席位租赁		
代销金融产品业务		3,484.45
<b>期货经纪业务</b>		
<b>2、投资银行业务</b>		4,262,264.15
其中：证券承销业务		3,950,943.40
保荐服务业务		
财务顾问业务		311,320.75
<b>3、资产管理业务</b>	3,086,772.00	950,303.53
<b>4、基金管理业务</b>		
<b>5、投资咨询业务</b>		
<b>6、股权托管服务业务</b>		
<b>7、其他</b>		12,512.50
<b>手续费及佣金支出合计</b>	<b>217,137,745.35</b>	<b>234,070,260.56</b>
<b>手续费及佣金净收入</b>	<b>612,912,799.11</b>	<b>980,293,919.88</b>
其中：财务顾问业务净收入	66,593,377.51	75,490,642.91
—并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司	28,451,886.79	33,728,301.89
—并购重组财务顾问业务净收入-其他		835,849.05
—其他财务顾问业务净收入	38,141,490.72	40,926,491.97



**2、 代销金融产品业务列示:**

代销金融产品业务	本期数		上期数	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	1,199,887,284.32	14,437,905.24	1,356,243,759.13	11,200,346.06
其他	29,870,488,125.01	1,096,267.93	30,595,820,536.02	1,814,519.99
合计	31,070,375,409.33	15,534,173.17	31,952,064,295.15	13,014,866.05

**(十五) 利息净收入**

项目	本期数	上期数
<b>利息收入</b>	717,597,465.40	890,300,902.82
1、存放金融同业利息收入	183,656,432.77	298,627,681.33
其中：自有资金存款利息收入	48,049,184.79	120,782,177.02
客户资金存款利息收入	135,607,247.98	177,845,504.31
2、融资融券利息收入	414,796,744.11	447,860,926.42
3、买入返售金融资产利息收入	119,144,288.52	143,812,295.07
其中：约定式购回利息收入		
股票质押回购利息收入	83,119,195.43	46,101,737.22
4、拆出资金利息收入		
5、其他		
<b>利息支出</b>	281,803,978.30	577,982,765.26
1、客户资金存款利息支出	30,206,643.87	40,116,499.29
2、卖出回购金融资产利息支出	59,345,197.16	133,690,232.73
其中：报价回购利息支出		
3、短期借款利息支出	2,552,324.10	2,457,618.00
4、拆入资金利息支出	9,649,664.46	12,584,806.60
其中：转融通利息支出		
5、长期借款利息支出		
6、固定收益凭证利息支出	48,177,937.42	73,562,441.72
7、次级债券利息支出	68,406,207.84	181,220,833.60
8、两融收益权转让利息支出	20,854,583.33	61,150,333.32
9、公司债券利息支出	42,405,039.70	73,200,000.00
10、其他	206,380.42	
<b>利息净收入</b>	435,793,487.10	312,318,137.56

**(十六) 现金流量表补充资料**

项目	本期数	上期数
一、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	408,559,347.66	532,757,688.88
加：资产减值准备	5,443,282.39	-4,770,795.29
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	58,164,816.74	25,728,596.14
无形资产摊销	14,170,224.85	12,967,891.54

长期待摊费用摊销	4,048,286.19	3,945,302.31
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-43,746.24	-6,643,184.78
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	287,044.04	
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-35,485,737.42	66,102,251.83
利息支出	158,989,184.96	327,983,275.32
投资损失（收益以“-”号填列）	-25,595,325.29	-12,042,897.03
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	17,835,125.03	-39,661,472.92
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	5,362,393.01	-12,962,886.55
以公允价值计量且变动计入当期损益金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-125,140,661.72	1,871,272,159.32
可供出售金融资产净减少额（增加以“-”号填列）	-11,850,234.20	4,299,666,602.34
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	211,706,197.32	4,526,328,774.50
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-2,092,028,795.55	-14,472,807,397.16
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-1,405,578,598.23	-2,882,136,091.55
二、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		
三、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	5,699,497,247.63	8,205,012,195.04
减：现金的年初余额	8,205,012,195.04	11,138,958,371.96
加：现金等价物的期末余额	1,923,241,896.63	2,373,518,396.72
减：现金等价物的年初余额	2,373,518,396.72	5,168,041,885.30
现金及现金等价物净增加额	-2,955,791,447.50	-5,728,469,665.50

## 十七、其他补充资料

### (一) 非经常性损益明细表：

项目（收益+，损失-）	本期数	上期数
（一）非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分；	-495,206.86	6,643,184.78
（二）越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免；		
（三）计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外；	7,075,172.33	4,718,761.22

(四) 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费;		
(五) 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;		
(六) 非货币性资产交换损益;		
(七) 委托他人投资或管理资产的损益;		
(八) 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;		
(九) 债务重组损益;		
(十) 企业重组费用, 如安置职工的支出、整合费用等;		
(十一) 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;		
(十二) 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;		
(十三) 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益;	2,416,896.20	2,472,780.63
(十四) 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;		
(十五) 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回;		114,021.18
(十六) 对外委托贷款取得的损益;		
(十七) 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;		
(十八) 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;		
(十九) 受托经营取得的托管费收入;		
(二十) 除上述各项之外的其他营业外收入和支出;	-2,713,608.60	-1,750,622.20
(二十一) 其他符合非经常性损益定义的损益项目;		
(二十二) 少数股东损益的影响数;	-1,332,387.95	-73,494.12
(二十三) 所得税的影响数;	-1,092,719.36	-3,012,034.40
合计	3,858,145.76	9,112,597.09

本公司对非经常性损益项目的确认依照中国证券监督管理委员会《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》(公告第 1 号)的规定执行。

本公司作为证券经营机构, 持有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负债以及处置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负债和可供出售金融资产等业务均属于本公司正常经营业务，持有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负债产生的公允价值变动损益，以及处置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负债和可供出售金融资产取得的投资收益，不作为非经常性损益披露。

(二) 净资产收益率和每股收益：

期间	项目	加权平均净资产收益率(%)	每股收益（元/股）	
			基本每股收益	稀释每股收益
本期数	归属于公司普通股股东的净利润	4.42	0.17	0.17
	扣除非经常性损益后归属于公司股东的净利润	4.38	0.16	0.16
上期数	归属于公司普通股股东的净利润	5.36	0.20	0.20
	扣除非经常性损益后归属于公司股东的净利润	5.26	0.20	0.20

本公司依照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号—净资产收益率与每股收益的计算及披露》（2010 年修订）的规定计算净资产收益率和每股收益。

上述财务指标计算公式如下：

$$1、\text{加权平均净资产收益率} = P_0 / (E_0 + NP \div 2 + E_i \times M_i \div M_0 - E_j \times M_j \div M_0 \pm E_k \times M_k \div M_0)$$

其中：P<sub>0</sub> 分别对应于归属于公司普通股股东的净利润、扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润；NP 为归属于公司普通股股东的净利润；E<sub>0</sub> 为归属于公司普通股股东的期初净资产；E<sub>i</sub> 为报告期发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产；E<sub>j</sub> 为报告期回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产；M<sub>0</sub> 为报告期月份数；M<sub>i</sub> 为新增净资产次月起至报告期期末的累计月数；M<sub>j</sub> 为减少净资产次月起至报告期期末的累计月数；E<sub>k</sub> 为因其他交易或事项引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动；M<sub>k</sub> 为发生其他净资产增减变动次月起至报告期期末的累计月数。

报告期发生同一控制下企业合并的，计算加权平均净资产收益率时，被合并方的净资产从报告期期初起进行加权；计算扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率时，被合并方的净资产从合并日的次月起进行加权。计算比较期间的加权平均净资产收益率时，被合并方的净利润、净资产均从比较期间期初起进行加权；计算比较期间扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率时，被合并方的净资产不予加权计算。

$$2、\text{基本每股收益} = P_0 \div S$$

$$S = S_0 + S_1 + S_i \times M_i \div M_0 - S_j \times M_j \div M_0 - S_k$$

其中：P<sub>0</sub> 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于普通股股东的净利润；

S 为发行在外的普通股加权平均数；S0 为期初股份总数；S1 为报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数；Si 为报告期因发行新股或债转股等增加股份数；Sj 为报告期因回购等减少股份数；Sk 为报告期缩股数；M0 报告期月份数；Mi 为增加股份次月起至报告期期末的累计月数；Mj 为减少股份次月起至报告期期末的累计月数。

3、稀释每股收益= $P1/(S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk + \text{认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数})$

其中，P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润，并考虑稀释性潜在普通股对其影响，按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时，考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响，按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益，直至稀释每股收益达到最小值。

4、报告期内，本公司不存在稀释性潜在普通股，稀释每股收益与基本每股收益相同。

## 十八、本报告期波动幅度较大的主要财务报表项目及其原因说明

### (一) 合并报表

单位：万元

项目	2017 年末或 2017 年度	2016 年末或 2016 年度	波动金额	波动比例(%)	波动原因
长期股权投资	24,257.50	9,758.17	14,499.33	148.59	本期投资设立参股公司；对参股公司增资；权益法核算被投资单位富安达经营效益增加
固定资产	99,481.61	31,162.64	68,318.97	219.23	办公大楼达到预订可使用状态，转入固定资产
在建工程	-	64,831.84	-64,831.84	-100.00	办公大楼达到预订可使用状态，转入固定资产
其他资产	5,349.36	3,962.80	1,386.56	34.99	本期预付上市费用及长期待摊费用中装修费支出增加
应付短期融资券	165,391.00	-	165,391.00		本期发行固定收益凭证
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	5,772.01	-5,772.01	-100.00	本期到期清偿交易性金融负债
代理承销证券款	95.37	10.83	84.54	780.62	期末应付客户基金赎回款增加
衍生金融负债	105.16	-	105.16		期末持有的商品期权
应付利息	6,630.60	15,818.36	-9,187.76	-58.08	本期兑付到期公司债和次级债并偿还应付利息
预计负债	54.18	1,300.84	-1,246.66	-95.84	本期支付前期计提的诉讼预计损失

应付债券	169,717.98	420,000.00	-250,282.02	-59.59	本期偿还到期公司债和次级债
递延所得税负债	731.54	1,294.69	-563.15	-43.50	期末金融资产公允价值变动时间性差异金额减少
其他负债	51,009.67	83,238.42	-32,228.75	-38.72	纳入合并范围结构化主体清偿优先级份额
其他综合收益	-1,036.80	3,423.15	-4,459.95	-130.29	可供出售公允价值变动金额下降
手续费及佣金净收入	64,669.08	101,580.08	-36,911.00	-36.34	市场行情变化，经纪业务和投资银行业务收入规模下降
利息净收入	44,859.22	31,122.21	13,737.01	44.14	本期偿还到期公司债和次级债，致使本期计提利息支出金额降低
资产处置收益	6.94	729.82	-722.88	-99.05	本期非流动资产转让收益减少
公允价值变动收益	3,277.69	-12,313.28	15,590.97	-126.62	市场行情变化，本期持仓股票公允价值上升
汇兑收益	-188.27	195.92	-384.19	-196.09	汇率变动影响
其他收益	239.00		239.00		子公司宁夏股交中心收到的挂牌补助款
税金及附加	1,620.10	4,512.88	-2,892.78	-64.10	营改增影响；营业收入规模下降
资产减值损失	546.81	-75.75	622.56	821.91	股票质押式回购业务规模上升

## (二) 母公司报表

单位：万元

项目	2017 年末或 2017 年度	2016 年末或 2016 年度	波动金额	波动比例(%)	波动原因
货币资金	569,949.72	820,501.22	-250,551.50	-30.54	市场行情变化，客户资金存款余额减少
应收款项	612.46	981.62	-369.16	-37.61	应收资产管理费增加
固定资产	99,155.37	30,766.52	68,388.85	222.28	办公大楼达到预订可使用状态，转入固定资产
在建工程	-	64,831.84	-64,831.84	-100.00	办公大楼达到预订可使用状态，转入固定资产
其他资产	4,960.24	3,083.07	1,877.17	60.89	本期预付上市费用及长期待摊费用中装修费支出增加
应付短期融资款	166,391.00	-	166,391.00		本期发行固定收益凭证
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	5,772.01	-5,772.01	-100.00	本期到期清偿交易性金融负债
衍生金融负债	105.16	-	105.16		期末持有的商品期权
代理承销证券款	95.37	10.83	84.54	780.62	期末应付客户基金赎回款增加
应付利息	6,661.48	15,818.36	-9,156.88	-57.89	本期兑付到期公司债和次级债并偿还应付利息

预计负债	54.18	1,300.84	-1,246.66	-95.84	本期支付前期计提的诉讼预计损失
应付债券	169,717.98	420,000.00	-250,282.02	-59.59	本期偿还到期公司债和次级债
递延所得税负债	710.26	1,294.69	-584.43	-45.14	期末金融资产公允价值变动时间性差异金额减少
其他综合收益	-927.72	3,705.45	-4,633.17	-125.04	可供出售公允价值变动金额下降
手续费及佣金净收入	61,291.28	98,029.39	-36,738.11	-37.48	市场行情变化,经纪业务和投资银行业务收入规模下降
利息净收入	43,579.35	31,231.81	12,347.54	39.54	本期偿还到期公司债和次级债,致使本期计提利息支出金额降低
资产处置收益	4.37	729.82	-725.45	-99.40	本期非流动资产转让收益减少
公允价值变动收益	3,524.68	-6,610.23	10,134.91	153.32	市场行情变化,本期持仓股票公允价值上升
汇兑收益	-188.27	195.92	-384.19	-196.09	汇率变动影响
税金及附加	1,559.36	4,421.23	-2,861.87	-64.73	营改增影响;营业收入规模下降
资产减值损失	544.33	-477.08	1,021.41	214.10	股票质押式回购业务规模上升

#### 十九、财务报表之批准报出

本财务报告经公司第二届董事会第十四次会议于 2018 年 2 月 23 日决议批准。

南京证券股份有限公司  
二〇一八年二月二十三日



附:

### 备查文件目录

(一) 载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人(会计主管人员)签名并盖章的财务报表。

(二) 载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。

(三) 年度内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

文件备置地址:

南京市江东中路 389 号

南京证券股份有限公司  
二〇一八年二月二十三日