

公司代码：601099

公司简称：太平洋

太平洋证券股份有限公司
THE PACIFIC SECURITIES CO., LTD



601099

2017 年半年度报告

重要提示

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

二、未出席董事情况

未出席董事职务	未出席董事姓名	未出席董事的原因说明	被委托人姓名
董事	何忠泽	工作原因	黄慧馨

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人李长伟、主管会计工作负责人周岚及会计机构负责人曹奕声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司无半年度利润分配预案或公积金转增股本预案。

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告涉及的未来经营计划等前瞻性陈述，不构成公司对投资者的实质承诺，请投资者注意投资风险。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、重大风险提示

公司主营业务与国内宏观经济环境、资本市场走势密切相关，证券行业的监管政策调整和资本市场的波动都将对公司经营业绩产生重大影响。

公司已在本报告中详细描述在经营活动中面临的风险，可能对公司未来发展战略和经营目标的实现产生不利影响的风险因素主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及其他风险。详见“第四节 经营情况的讨论与分析”关于“二、（二）可能面对的风险”部分的内容。

十、其他

适用 不适用

目 录

第一节	释义	4
第二节	公司简介和主要财务指标	5
第三节	公司业务概要	10
第四节	经营情况的讨论与分析	13
第五节	重要事项	27
第六节	普通股股份变动及股东情况	38
第七节	优先股相关情况	40
第八节	董事、监事、高级管理人员情况	40
第九节	公司债券相关情况	41
第十节	财务报告	46
第十一节	备查文件目录	135
第十二节	证券公司信息披露	136

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
公司/太平洋证券	指	太平洋证券股份有限公司
报告期	指	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
太证资本	指	太证资本管理有限责任公司，公司全资子公司
太证非凡	指	太证非凡投资有限公司，公司全资子公司
老-中证券	指	老-中证券有限公司，公司境外参股子公司
上海太证	指	上海太证投资管理有限公司，太证资本全资子公司
正奇国际	指	正奇国际控股有限公司 BVI，上海太证境外全资子公司
股东大会	指	太平洋证券股份有限公司股东大会
董事会	指	太平洋证券股份有限公司董事会
监事会	指	太平洋证券股份有限公司监事会
华信六合	指	北京华信六合投资有限公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
云南证监局	指	中国证券监督管理委员会云南监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
滇桂金改	指	2013 年 11 月 20 日，中国人民银行等 11 个部委办联合印发了《云南省广西壮族自治区建设沿边金融综合改革试验区总体方案》，旨在大力推动滇桂两省区沿边金融综合改革试验区建设，促进沿边金融、跨境金融、地方金融改革创新先行先试，促进人民币周边区域化，全面提升两省区对外开放和贸易投资便利化水平，为我国深入推进金融改革开放提供经验借鉴，推动国家西部大开发和沿边大开放实现新的突破发展
一带一路	指	“丝绸之路经济带”和“21 世纪海上丝绸之路”的简称。习近平总书记于 2013 年 9 月和 10 月分别提出建设“新丝绸之路经济带”和“21 世纪海上丝绸之路”的战略构想，旨在借用古代“丝绸之路”的历史符号，高举和平发展的旗帜，主动地发展与沿线国家的经济合作伙伴关系，共同打造政治互信、经济融合、文化包容的利益共同体、命运共同体和责任共同体
ABS	指	资产证券化业务，是指以基础资产所产生的现金流为偿付支持，通过结构化等方式进行信用增级，在此基础上发行资产支持证券的业务活动
《公司章程》	指	《太平洋证券股份有限公司章程》
中国/我国/国内/ 全国/境内/国家	指	中华人民共和国，在本报告中，如无特别说明，不包含香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
元	指	人民币元

注：本报告中若出现总数与各分项值之和尾数不符的情况，均为四舍五入原因造成。

第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司信息

公司的中文名称	太平洋证券股份有限公司
公司的中文简称	太平洋
公司的外文名称	THE PACIFIC SECURITIES CO., LTD
公司的外文名称缩写	PACIFIC SECURITIES
公司的法定代表人	李长伟
公司总经理	李长伟

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,816,316,370.0	6,816,316,370.00
净资产	12,520,842,622.77	11,415,593,159.73

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

公司经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券承销与保荐；证券资产管理；证券投资基金销售；代销金融产品；融资融券；中国证监会批准的其他业务。

公司各单项业务资格如下：

- 1、证券经纪业务资格；
- 2、证券投资咨询资格；
- 3、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问资格；
- 4、证券自营业务资格；
- 5、证券承销与保荐业务资格；
- 6、证券资产管理业务资格；
- 7、证券投资基金销售业务资格；
- 8、代销金融产品业务资格；
- 9、融资融券业务资格；
- 10、网上证券委托业务资格；
- 11、中国证券登记结算有限责任公司结算参与者资格；
- 12、新股网下询价业务资格；
- 13、全国银行间同业拆借市场资格；
- 14、上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格；
- 15、经营外汇业务资格；
- 16、中小企业私募债券承销业务资格；

- 17、作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事推荐业务和经纪业务资格；
- 18、约定购回式证券交易业务资格；
- 19、股票质押式回购交易业务资格；
- 20、自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格；
- 21、作为合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务资格；
- 22、作为做市商在全国中小企业股份转让系统从事做市业务资格；
- 23、沪港通下港股通业务交易权限；
- 24、互联网证券业务试点资格；
- 25、为期货公司提供中间介绍业务资格；
- 26、私募基金综合托管业务资格；
- 27、客户资金消费支付服务业务资格；
- 28、上海证券交易所股票期权交易参与者资格；
- 29、深港通下港股通业务交易权限；
- 30、转融通业务资格；
- 31、上市公司股权激励行权融资业务试点资格。

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	唐卫华	栾峦
联系地址	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
电话	0871-68898121	0871-68898121
传真	0871-68898100	0871-68898100
电子信箱	tangweihua@tpyzq.com	luanluan@tpyzq.com

三、基本情况变更简介

公司注册地址	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
公司注册地址的邮政编码	650224
公司办公地址	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
公司办公地址的邮政编码	650224
公司网址	http://www.tpyzq.com
电子信箱	tpy@tpyzq.com

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	www.sse.com.cn
公司半年度报告备置地点	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码
A股	上海证券交易所	太平洋	601099

六、其他有关资料

适用 不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年 同期增减(%)
营业收入	373,544,122.97	593,975,276.08	-37.11
归属于母公司股东的净利润	-123,199,035.32	146,303,200.09	—
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	-126,686,151.12	145,189,617.46	—
经营活动产生的现金流量净额	1,378,673,326.91	-2,680,064,242.51	—
其他综合收益	-21,177,596.78	-6,853,993.15	—
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年 度末增减(%)
资产总额	39,490,152,958.83	40,364,697,117.58	-2.17
负债总额	27,622,829,850.86	27,770,436,437.59	-0.53
归属于母公司股东的权益	11,482,147,907.34	11,817,176,734.39	-2.84
所有者权益总额	11,867,323,107.97	12,594,260,679.99	-5.77

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同 期增减(%)
基本每股收益(元/股)	-0.018	0.033	—
稀释每股收益(元/股)	-0.018	0.033	—
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	-0.019	0.033	—
加权平均净资产收益率(%)	-1.05	1.35	减少2.40个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	-1.08	1.34	减少2.42个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	12,520,842,622.77	11,415,593,159.73

净资产	11,430,911,724.56	11,761,380,787.55
风险覆盖率(%)	240.83	213.53
资本杠杆率(%)	25.99	28.05
流动性覆盖率(%)	164.85	510.52
净稳定资金率(%)	124.99	132.55
净资本/净资产(%)	109.53	97.06
净资本/负债(%)	55.56	51.96
净资产/负债(%)	50.72	53.53
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	14.29	35.01
自营固定收益类证券/净资本(%)	75.11	53.16
风险资本准备之和	5,199,141,390.38	5,346,051,146.77

八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

九、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-88,977.13	固定资产清理损失
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	3,390,166.00	落户奖励等
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	1,412,743.60	收到代扣手续费返还等收入
少数股东权益影响额	-48,097.72	
所得税影响额	-1,178,718.95	
合计	3,487,115.80	

十、其他

适用 不适用

（一）采用公允价值计量的项目

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末余额	期初余额	当期变动	对当期利润的影响金额
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	9,480,448,649.13	7,563,931,191.26	1,916,517,457.87	-160,044,270.24
可供出售金融资产	3,083,751,886.89	4,249,650,914.57	-1,165,899,027.68	113,893,591.22
衍生金融资产	235,361,670.88	243,444,369.60	-8,082,698.72	-346,303.62
金融资产小计	12,799,562,206.90	12,057,026,475.43	742,535,731.47	-46,496,982.64
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	970,724,087.74	1,113,470,014.66	-142,745,926.92	-28,865,859.42
衍生金融负债	102,563,318.83	91,924,991.52	10,638,327.31	不适用

金融负债小计	1,073,287,406.57	1,205,395,006.18	-132,107,599.61	-28,865,859.42
--------	------------------	------------------	-----------------	----------------

(二) 比较式财务报表中变动幅度超过 30% 以上的项目

单位：元 币种：人民币

项目	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)	备注
货币资金	4,234,806,533.93	6,561,678,339.59	-35.46	本期末自有资金较上年末减少
应收利息	247,001,974.69	158,133,556.76	56.20	本期末计提的信用业务投资债券规模增加，计提的利息较上年末增加
持有至到期投资	117,775,617.42	177,062,112.26	-33.48	本期末持有至到期投资规模下降
卖出回购金融资产款	10,281,640,859.96	5,331,979,081.90	92.83	本期末卖出回购规模较上年末增加
应付职工薪酬	248,089,095.82	399,300,814.39	-37.87	本期支付上年度计提的奖金
应交税费	47,886,137.32	97,856,176.10	-51.06	本期应税收入大幅下降，期末已计提未缴纳的税费相应减少
应付款项	75,327,314.94	50,733,504.38	48.48	本期末的应付客户基金赎回款较上年末增加
应付利息	206,864,677.94	406,033,102.19	-49.05	本期偿还上年度计提的部分公司债和次级债利息
应付债券	7,497,495,800.00	11,745,733,500.00	-36.17	本期偿还部分债券
递延所得税负债	1,613,741.73	4,241,872.26	-61.96	本期金融资产产生的应纳税暂时性差异减少
其他负债	73,816,307.21	50,630,210.79	45.79	本期末结构化主体应付款项增加
项目	2017 年 1-6 月	2016 年 1-6 月	增减幅度 (%)	备注
经纪业务手续费净收入	135,838,628.60	199,981,298.13	-32.07	本期市场交易量下降，经纪业务手续费收入较上年同期大幅下降
投资银行业务手续费净收入	41,685,889.01	84,560,189.89	-50.70	本期公司承销的股票和债券收入大幅下降
资产管理业务手续费净收入	88,843,766.00	45,546,714.59	95.06	本期的资产管理业务规模扩大，手续费净收入增加
投资收益	174,745,653.85	100,485,457.81	73.90	本期金融资产的投资收益大幅增长
公允价值变动收益	-217,425,530.45	-4,763,256.72	—	本期交易性金融资产的公允价值变动与上年同期相比下降
汇兑收益	-1,802,736.56	1,178,801.79	—	本期人民币汇率下降，上年同期为上升
其他业务收入	2,727,073.32	38,034.59	7,069.98	本期新增融资租赁收入
税金及附加	4,275,465.49	36,609,732.07	-88.32	本期应税收入下降，相应的税金及附加下降
资产减值损失	-11,316,785.62	-16,643,052.11	—	本期收回大额已计提坏账准备的其他应收款，因此冲回上期计提的减值准备
营业外收入	5,731,319.86	1,523,294.94	276.24	本期收到政府补助，较上年同期增加
营业外支出	1,017,387.39	38,414.14	2,548.47	本期捐赠支出较上年同期增加
所得税费用	33,230,076.24	10,720,272.23	209.97	本年的应纳税所得额较上年同期增长
经营活动产生的现金流量净额	1,378,673,326.91	-2,680,064,242.51	—	本期回购业务资金为净流入，而上年同期回购业务资金为净流出
投资活动产生的现金流量净额	1,420,349,558.24	-552,352,337.01	—	本期收回投资（含出售可供出售金融资产）的资金为净流入，而上年同期为现金净流出
筹资活动产生的现金流量净额	-5,697,252,661.32	4,306,471,609.07	—	本期吸收投资的现金流入较上年同期减少，本期偿还债务的现金流出较上年同期增加
基本每股收益	-0.018	0.033	—	本期利润大幅下降，导致每股收益大幅下降

第三节 公司业务概要

一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

(一) 公司所从事的主要业务、经营模式

1、证券经纪业务

公司证券经纪业务即证券代理买卖业务，是公司一项基本业务。近年来，随着我国证券市场融资融券、股票质押式回购交易等创新业务的开放和各项金融创新政策的推出，证券经纪业务亦由传统单一的通道业务向以满足客户需求为中心的多样化的财富管理业务转型。报告期内，公司该项业务受市场交易量下降的影响，业绩较上年同期有所下降。

2、投资银行业务

公司投资银行业务范围包括 IPO、再融资等股票承销保荐业务，企业债、公司债等债券发行承销业务，改制、并购重组等财务顾问业务，新三板业务等。公司投资银行业务根据政策和市场环境的变化，调整盈利模式，探索从通道业务转型为综合金融服务，为企业提供多途径融资、上市、增发、并购重组等系列服务。同时在深度解读分层制度的基础上开展新三板业务，持续推进推荐挂牌业务、做市业务、持续督导工作。此外，积极开拓资产证券化等新业务领域，努力探索创新业务模式。报告期内，公司在并购重组、债券、ABS 等业务领域取得了一定进展。

3、证券投资业务

公司证券投资业务主要为以公司自有资金投资沪深交易所上市股票、基金和债券等以及中国金融交易所股指期货、期权等。公司经过深度研究上市公司进行自下而上的投资，通过赚取股票或基金的买卖价差和股票分红获取收益。股市的变化对该项业务的业绩影响较大，因受 A 股市场波动和风格偏好影响，报告期内，公司证券投资业务收益出现较大幅度下降。

4、资产管理业务

公司资产管理业务分为：为单一客户办理的定向资产管理业务、为多个客户办理的集合资产管理业务以及为客户办理特定目的的专项资产管理业务。公司以固定收益投资作为资产管理业务的重点发展方向，形成了以“中小银行理财服务+债券投资”的业务重点。公司资产管理业务结构逐步优化，投资领域不断拓展，管理的产品类型涵盖债券类、股票类、定增、员工持股、大股东增持、量化、股票质押、ABS 等，满足了不同风险偏好、不同资产规模的多元理财需求。报告期内，公司资产管理业务业绩稳定发展。

5、私募投资基金业务

根据中国证券业协会 2016 年 12 月 30 日发布的《证券公司私募投资基金子公司管理规范》，公司原直投子公司太证资本向私募投资基金子公司转型，主要业务变更为私募投资基金管理，经营模式变更为发起设立及管理私募投资基金收取管理费并获取业绩超额收益分成。报告期内，公司该项业务有序开展。

6、另类投资业务

根据中国证券业协会 2016 年 12 月 30 日发布的《证券公司另类投资子公司管理规范》，另类投资业务是指从事《证券公司证券自营投资品种清单》所列品种以外的金融产品、股权等另类投资。公司另类投资子公司太证非凡的主要经营模式为利用自有资金对非上市公司进行权益性投资，之后以上市、并购、原股东回购、新三板转让等退出方式获取收益；利用自有资金投资于《证券公司证券自营投资品种清单》以外的金融产品，通过金融产品增值获取收益。报告期内，二级市场基金投资业绩良好，公司该项业务取得了优异的投资回报。

(二) 公司所处的行业发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

公司所处行业为证券行业。我国证券行业与欧美国家相比起步较晚，初级的发展阶段也意味着巨大的发展潜力。随着经济的发展和资本市场体制的完善，我国证券行业发展迅猛，证券公司业务范围和服务能力不断提升。近年来，在政策的引导下，我国证券行业充满机遇，“十三五”规划明确提出“提升直接融资占比”，这意味着资本市场将加速成长，为国家经济转型升级提供基础金融环境，这是资本市场的历史使命，也是证券行业发展的机遇。

证券行业是一个周期性较明显的行业，因其经纪业务、融资融券业务、自营业务等与证券市场的交易量、价格波动等因素具有较高的相关性，而证券市场的波动受宏观经济的影响较大，导致证券行业呈现周期性特征。2017 年上半年国内经济下行压力依然存在，四月份股票和债券市场波动较大，影响证券行业的整体盈利水平。

公司始终坚持合规经营的持续发展之路，作为云南的区域龙头券商，经纪业务在云南排名第一，收益稳定，并已经逐步由区域型证券公司成长为一家全国性的券商。目前，在业内为中等规模。

二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

适用 不适用

报告期内公司总资产规模变化较小。截至 6 月 30 日，公司总资产 394.90 亿元，较年初下降 8.75 亿元，略降 2.17%，公司的主要资产中长期股权投资、固定资产和无形资产变化幅度较小，如下表：

单位：元 币种：人民币

项目	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
长期股权投资	70,245,159.14	68,246,606.00	2.93
固定资产	284,199,962.24	278,377,724.40	2.09
无形资产	31,873,171.88	33,507,761.58	-4.88

其中：境外资产 289,337,972.10 (单位：元 币种：人民币)，占总资产的比例为 0.73%。

公司境外资产较年初增长了 1.69 亿元，增长了 140.20%，增长的主要原因是：公司二级全资子公司上海太证境外全资子公司正奇国际取得 2,400 万美元贷款（折合人民币 1.63 亿元）。报告期内，境外资产实现营业收入 2.91 万元，实现净利润-235.54 万元。

其他资产中变动幅度超过 20% 以上的项目包括：

项目	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
货币资金	4,234,806,533.93	6,561,678,339.59	-35.46
结算备付金	1,309,778,184.56	1,702,930,780.52	-23.09
交易性金融资产	9,480,448,649.13	7,563,931,191.26	25.34
应收利息	247,001,974.69	158,133,556.76	56.20
可供出售金融资产	3,698,003,426.67	5,019,377,437.23	-26.33
持有至到期投资	117,775,617.42	177,062,112.26	-33.48

三、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

公司作为云南的区域龙头券商，经纪业务在云南排名第一，收益稳定；信用业务和资产管理业务发展较快；新三板和互联网证券等新业务得到及时推进；投行、固定收益具有较好的客户积累和市场口碑；同时公司机制灵活，市场反应敏捷。

区位优势显著：公司作为云南本土的上市券商，长期以来得到当地政府的大力支持。目前，公司经纪等业务在云南市场占有率排名第一。同时，受益于国家“一带一路”、滇桂金改政策以及滇桂地区证券化快速发展带来的机遇，公司不仅在云南区域精耕细作，业务范围也将逐步辐射至东南亚。

具有良好的市场化机制：公司制度体系完备，不仅涵盖薪酬奖励、考核晋升、风险控制等方面，且适于证券行业的创新环境，为公司业务和管理转型提供了制度和机制保障。

第四节 经营情况的讨论与分析

一、经营情况的讨论与分析

2017 年上半年，受货币政策收紧、去杠杆不断加强的影响，指数、个股分化严重。从指数看，上证指数和深证成指分别上涨了 2.86% 和 3.46%，上证 50 更是上涨了 11.5%，但创业板指数的最低点已经到了前两轮股灾时的低点附近，上半年下跌了 7.34%。根据 Wind 数据统计，上半年 A 股成交额 51.91 万亿元，较上年同期的 63.65 万亿元同比下降了 18.45%。受上半年 A 股市场行情低迷的影响，公司整体业绩呈现下跌趋势。

公司 2017 年上半年实现营业收入 37,354.41 万元，较上年同期的 59,397.53 万元下降了 37.11%；归属于上市公司股东的净利润-12,319.90 万元，较上年同期的 14,630.32 万元下降了 26,950.22 万元。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司资产总计 3,949,015.30 万元，较上年末略降 2.17%；负债合计 2,762,282.99 万元，较上年末略降 0.53%；归属于上市公司股东的所有者权益 1,148,214.79 万元，较上年末下降了 2.84%。资产负债结构合理。

(一) 主营业务分析

1、财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	373,544,122.97	593,975,276.08	-37.11
营业成本	457,633,391.81	440,937,709.98	3.79
经营活动产生的现金流量净额	1,378,673,326.91	-2,680,064,242.51	—
投资活动产生的现金流量净额	1,420,349,558.24	-552,352,337.01	—
筹资活动产生的现金流量净额	-5,697,252,661.32	4,306,471,609.07	—

营业收入变动原因说明：

报告期内，公司实现营业收入 3.74 亿元，比上年同期减少了 2.20 亿元，下降了 37.11%。营业收入下降的主要原因是：（1）受市场交易量萎缩的影响，经纪业务收入较上年同期大幅下降；（2）证券投资业务受到行情波动的影响，收益出现较大幅度下降；（3）投资银行业务因业务发展受限，业绩较上年同期有所下降。

营业收入的主要构成如下：

单位：万元 币种：人民币

营业收入构成	2017 年 1-6 月		2016 年 1-6 月		本期金额较上年同期变动比例 (%)
	金额	占营业收入比例 (%)	金额	占营业收入比例 (%)	
经纪业务手续费净收入	13,583.86	36.36	19,998.13	33.67	-32.07

投资银行业务手续费净收入	4,168.59	11.16	8,456.02	14.24	-50.70
资产管理业务手续费净收入	8,884.38	23.78	4,554.67	7.67	95.06
利息净收入	14,621.97	39.14	16,245.74	27.35	-10.00
投资收益	17,474.57	46.78	10,048.55	16.92	73.90
公允价值变动收益	-21,742.55	-58.21	-476.33	-0.80	—

主营业务分行业和分产品情况的说明

单位：万元 币种：人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
证券经纪业务	28,623.57	16,985.94	40.66	-58.78	-14.82	减少 30.63 个百分点
证券投资业务	-20,282.56	135.04	—	—	-95.51	—
投资银行业务	4,394.52	6,908.28	-57.20	-47.40	42.32	减少 99.10 个百分点
资产管理业务	11,338.92	5,469.45	51.76	75.00	55.31	增加 6.12 个百分点

(1) 证券经纪业务

报告期内，经纪业务实现营业收入 2.86 亿元，较上年同期下降 58.78%。主要原因是 2017 年上半年，两市日成交额大幅萎缩，根据 Wind 数据统计，上半年 A 股成交额 51.91 万亿元，较上年同期的 63.65 万亿元同比下降了 18.45%。交易的萎缩直接带来经纪业务佣金收入的下滑，间接影响信用交易和融资融券规模的下降，除受市场行情与交投的冲击之外，持续下行的佣金率也是抑制经纪业务的重要因素。

截至报告期末，公司的信用业务规模 110.90 亿元，较上年末下降 8.47%，其中公司质押回购融出资金 90.72 亿元，较上年末下降 11.41%，两融业务融出资金 20.80 亿元，较上年末略增 3.48%。

受交易量和佣金率双双下降的影响，公司上半年手续费及佣金净收入 1.36 亿元，与上年同期相比下降 32.07%。报告期内，公司经纪业务实现营业利润 1.16 亿元，较上年同期减少 6.46%。

(2) 证券投资业务

2017 年上半年，A 股市场在金融去杠杆、强监管的大背景下，市场风格表现结构化明显，IPO 加速和再融资政策收紧均对成长股构成压制。根据 Wind 资讯数据，截至 6 月 30 日，沪深两市 3,281 只股票中，半年时间里涨幅中位数为-11.05%，上涨的股票仅 1,002 只，占比不到 1/3；如剔除在今年上半年上市的次新股，沪深两市 3,032 只股票中，半年涨幅中位数为跌 12.63%，上涨股票更是仅剩 761 只，占比仅 1/4。

受市场因素影响，报告期内公司证券投资业务实现营业收入-2.03 亿元，较上年同期减少 1.72 亿元，其中：投资收益 2,541.92 万元，公允价值变动收益-2.25 亿元。上半年实现营业收入利润-2.04 亿元，较上年同期减少 1.43 亿元。

(3) 投资银行业务

2017 年上半年，加强监管作为年内证券行业最重要的主题词，对于行业存量业务的影响极为深远。其中，并购重组当前正面临严格审核，非公开发行也全面进入了“限量、限时、限价”的新常态。尽管 IPO 自去年起保持了较快的发行速度，4 月中旬后 A 股陷入低迷，市场寻求下跌原因中，IPO 提速问题受到了关注，甚至引发 IPO 应否暂停的争论，投行业务整体较上年同期仍难有较高增长。

报告期内，公司投资银行业务实现营业收入 4,394.52 万元，较上年同期下降 47.40%；实现证券承销收入 1,031.70 万元；完成 12 家企业新三板推荐挂牌业务，实现挂牌和督导的财务顾问净收入 3,051.73 万元。上半年实现营业利润-2,513.76 万元，较上年同期减少 6,013.64 万元。

(4) 资产管理业务

2016 年下半年资产管理业务监管升级，2017 年 4 月证监会对资金池业务提出限制产品规模、限制投资范围（不得投资于私募债、资产证券化产品、高收益信用债券、低评级债券以及期限长的股票质押产品等流动性较差的品种）、控制久期错配、控制杠杆倍数等要求。2017 年 5 月证监会首提全面禁止通道业务，强调不得让渡管理责任。券商资管未来在摆脱同质化的通道业务和“空转套利”的资金池业务后将回归资管业务本源，依靠自身的投研能力从事价值挖掘、资产配置、风险管理业务。

截至报告期末，资产管理总部受托资产规模为 1,651.28 亿元，其中存续的集合资产管理计划管理规模 306.55 亿元。公司资产管理业务线条丰富，通过定向资产管理计划、集合资产管理计划及专项资产管理计划进行投资管理，业务板块涵盖固收投资、权益投资、量化衍生品投资、资产证券化及通道、资本市场业务。

报告期内，公司资产管理业务合理调整结构，加强内控管理，实现营业收入 1.13 亿元，较上年同期增长 75%；实现营业利润 5,869.47 万元，较上年同期增长 98.44%。

营业成本变动原因说明：

为促进企业今后的发展，公司引进了相应的人才，在全国范围布局了相应的分支机构，因此虽本期营业收入大幅下降，但业务及管理费并未同比下降。同时，去年 5 月 1 日后金融业“营改增”，公司缴纳增值税，导致税金及附加同比下降。

单位：万元 币种：人民币

营业成本构成	2017 年 1-6 月		2016 年 1-6 月		本期金额较上年同期变动比例 (%)
	金额	占总成本比例 (%)	金额	占总成本比例 (%)	
税金及附加	427.55	0.93	3,660.97	8.30	-88.32
业务及管理费	46,467.47	101.54	42,097.10	95.47	10.38
资产减值损失	-1,131.68	-2.47	-1,664.31	-3.77	—
合计	45,763.34	100.00	44,093.77	100.00	3.79

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：

经营活动产生的现金流量净流入为 13.79 亿元，比上年同期的净流出 26.80 亿元，净流入增加 40.59 亿元。其中现金流入 48.65 亿元，主要项目为：回购业务资金净增加额 35.79 亿元，收取利息、手续费及佣金产生的现金流入 10.45 亿元，融出资金净流入 1.44 亿元。现金流出 34.86 亿元，主要项目为：取得交易性金融资产净流出 21.07 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 4.57 亿元，代理买卖证券支付的现金净额 4.47 亿元。报告期经营活动现金流量净流入较上年同期增加的主要原因是：本期回购业务资金净流入 35.79 亿元，而上年同期回购业务资金为净流出 22.58 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：

投资活动产生的现金流量净流入为 14.20 亿元，比上年同期的净流出 5.52 亿元，净流入增加 19.72 亿元。其中现金流入 14.71 亿元，主要项目为：收回投资（含可供出售金融资产）收到的现金 13.52 亿元；取得投资收益收到的现金 1.14 亿元。现金流出 0.51 亿元，主要项目为：投资支出流出现金 0.18 亿元；购建固定资产等支付的现金 0.33 亿元。报告期投资活动产生的现金流量净流入较上年同期增加的主要原因是：本期收回投资（含出售可供出售金融资产）的现金净流入 13.52 亿元，而上年同期为现金净流出 6.54 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：

筹资活动产生的现金流量净流出为 56.97 亿元，比上年同期的净流入 43.06 亿元，净流出增加 100.03 亿元。其中现金流入 52.32 亿元，主要为发行债券收到的现金。现金流出 109.30 亿元，主要为偿还债务支付的现金 95.27 亿元，分配股利支付和偿付利息的现金 7.96 亿元。报告期筹资活动产生的现金流量净流出较上年同期增加的主要原因是：本期吸收投资收到的现金流入较上年同期减少了 42.09 亿元，偿还债务支付的现金流出较上年同期增加 38.27 亿元。

2、其他

(1) 公司利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

分行业或分产品	2017 年 1-6 月		2016 年 1-6 月	
	营业利润	占营业利润 (%)	营业利润	占营业利润 (%)
证券经纪业务	11,637.62	138.40	18,462.46	120.64
证券投资业务	-20,417.59	-242.81	-6,114.72	-39.96
投资银行业务	-2,513.76	-29.89	3,499.88	22.87
资产管理业务	5,869.47	69.80	2,957.74	19.33
其他	-2,984.67	-35.49	-3,501.60	-22.88
合计	-8,408.93	100.00	15,303.76	100.00

报告期内，公司虽然出现了亏损，但利润的来源结构变化不大，主要的利润还是来源于证券经纪业务和资产管理业务；亏损也主要是来源于证券投资业务。报告期内，资产管理业务由于合理调整结构，加强内控管理，因此本期实现的营业利润占公司总体营业利润 69.80%，较上年同期提高了 50 个百分点；投资银行业务由于本期亏损，因此对总体营业利润的贡献由正转负。

(2) 其他

□适用 √不适用

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

□适用 √不适用

(三) 资产、负债情况分析

√适用 □不适用

1、资产及负债状况

币种：人民币 单位：万元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
货币资金	423,480.65	10.72	656,167.83	16.26	-35.46	本期末自有资金减少
结算备付金	130,977.82	3.32	170,293.08	4.22	-23.09	本期末自有资金减少
融出资金	208,001.30	5.27	222,361.05	5.51	-6.46	本期末两融业务融资规模略减
交易性金融资产	948,044.86	24.01	756,393.12	18.74	25.34	本期末基金和债券投资规模增加
衍生金融资产	23,536.17	0.60	24,344.44	0.60	-3.32	本期末衍生金融资产规模略减
买入返售金融资产	1,728,483.48	43.77	1,590,534.89	39.40	8.67	本期末债券回购业务规模扩大
应收款项	7,320.81	0.19	8,058.39	0.20	-9.15	本期应收款项增加

应收利息	24,700.20	0.63	15,813.36	0.39	56.20	本期投资债券规模增加, 计提的利息相应增加
可供出售金融资产	369,800.34	9.36	501,937.74	12.44	-26.33	本期末投资规模减少
持有至到期投资	11,777.56	0.30	17,706.21	0.44	-33.48	本期末持有至到期投资规模减少
长期股权投资	7,024.52	0.18	6,824.66	0.17	2.93	子公司新增对联营企业的投资
其他资产	65,867.58	1.67	66,034.94	1.64	-0.25	——
资产总计	3,949,015.30	100.00	4,036,469.71	100.00	-2.17	
应付短期融资款	407,000.00	14.73	414,000.00	14.91	-1.69	本期发行短期公司债规模略减
以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融负债	97,072.41	3.51	111,347.00	4.01	-12.82	合并结构化主体产生的金融负债减少
衍生金融负债	10,256.33	0.37	9,192.50	0.33	11.57	本期衍生品投资规模增加
卖出回购金融资产款	1,028,164.09	37.22	533,197.91	19.20	92.83	本期末卖出规模增加
代理买卖证券款	388,422.29	14.06	433,853.32	15.62	-10.47	本期末客户资金余额减少
长期借款	16,258.56	0.59				三级子公司新增长期借款
应付债券	749,749.58	27.14	1,174,573.35	42.30	-36.17	本期偿还部分债券
其他负债	65,359.73	2.37	100,879.57	3.63	-35.21	本期支付了上期计提的相关税费及薪酬
负债合计	2,762,282.99	100.00	2,777,043.64	100.00	-0.53	

其他说明:

(1) 资产情况

截至 2017 年 6 月 30 日, 公司总资产 394.90 亿元, 较年初减少 8.75 亿元, 略减 2.17%。主要变动项目为: ① 货币资金 (含结算备付金) 期末余额较年初减少 27.20 亿元; ② 可供出售金融资产较年初减少 13.21 亿元; ③ 交易性金融资产较年初增加 19.17 亿元; ④ 买入返售金融资产较年初增加 13.79 亿元。

从资产结构上看, 本期末买入返售金融资产占比 43.77%, 主要为信用业务的股票质押式回购业务; 交易性金融资产占比 24.01%, 主要为基金和风险较低的债券投资; 货币资金、结算备付金占比 14.04%; 可供出售金融资产占比 9.36%, 主要为购入的资管产品及债券; 融出资金占比 5.27%; 长期股权投资仅占比 0.18%, 主要为母公司及子公司对联营企业的投资; 其他资产占比 1.21%, 主要为公司的房屋建筑物及购买的交易软件。公司的资产质量和流动性较好, 减值准备计提充分。

(2) 负债情况

截至 2017 年 6 月 30 日, 公司负债总额 276.23 亿元, 较年初略减 1.48 亿元, 减幅 0.53%。主要变化的项目是: ① 卖出回购金融资产款较年初增加 49.50 亿元; ② 应付债券较年初减

少 42.48 亿元；③ 代理买卖证券款较年初减少 4.54 亿元；④ 合并结构化主体产生的交易性金融负债较年初减少 1.43 亿元。

从负债结构上看，本期末卖出回购金融资产款占比 37.22%；应付债券占比 27.14%，主要为发行的公司债、次级债及长期收益凭证；应付短期融资款占比 14.73%；代理买卖证券款占比 14.06%；以公允价值计量且其变动记入当期损益的金融负债占比 3.51%；其他负债占比 2.37%。

2、截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	180,408,111.11	大额存单和定期存款
交易性金融资产	3,054,494,614.50	卖出回购交易质押或停牌
可供出售金融资产	325,402,167.96	以管理人身份认购的集合理财产品份额，承诺存续期内不退出或维持杠杆比例，或已融出

3、其他说明

适用 不适用

(四) 投资状况分析

1、对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末合并财务报表长期股权投资余额 7,024.51 万元，较上年末（6,824.66 万元）增加 199.85 万元，增长了 2.93%，主要是全资子公司太证资本的控股子公司湖北太证投资管理有限公司转让了其原控制的武汉光谷人才投资管理有限公司的部分股权，使该公司由原控股子公司变为联营企业，因此相应增加了合并财务报表的长期股权投资。

母公司层面，长期股权投资期末余额 18.28 亿元，较上年末（15.28 亿元）增加 3 亿元，主要是向全资子公司太证非凡增资 3 亿元。

(1) 重大的股权投资

适用 不适用

(2) 重大的非股权投资

适用 不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

序号	会计科目	投资成本	年末账面余额	报告期内购入或出售净额	报告期投资收益	报告期公允价值变动
1	以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	9,694,409,444.24	9,480,448,649.13	1,916,517,457.87	57,377,200.21	-217,421,470.45
2	衍生金融资产	不适用	235,361,670.88	-8,082,698.72	-342,243.62	-4,060.00
3	可供出售金融资产	3,185,300,126.69	3,083,751,886.89	-1,165,899,027.68	113,893,591.22	-22,634,935.52

(五) 重大资产和股权出售

□适用 √不适用

(六) 主要控股参股公司分析

√适用 □不适用

1、控股子公司

(1) 太证资本管理有限责任公司，成立于 2012 年 5 月，注册资本 10 亿元，为公司全资子公司。太证资本注册地为北京市丰台区右安门外开阳路 6 号侨园饭店南楼 3429 号，法定代表人为熊艳，公司类型为有限责任公司（法人独资），统一社会信用代码为 911100005977472105。经营范围为：使用自有资金或设立直投资基金，对企业进行股权投资或债权投资，或投资于与股权投资、债权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资、债权投资相关的财务顾问服务；在有效控制风险、保持流动性的前提下，以现金管理为目的，将闲置资金投资于依法公开发行的国债、央行票据、短期融资券、投资级公司债、货币市场基金及保本型银行理财产品等风险较低、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，或进行债券逆回购；中国证监会同意的其他业务。

太证资本致力于私募投资基金管理，管理的基金主要投资于先进制造业、新能源、环保、现代农业、新材料、医药医疗、现代服务业、人工智能等符合国家宏观政策及产业政策领域的优秀企业，通过服务实体经济实现企业自身的发展。

报告期内，太证资本减少子公司 2 家、直投资基金 2 家。截至 2017 年 6 月 30 日，太证资本控制的纳入母公司合并范围的主体为 19 家，总资产 150,834.74 万元，净资产 133,804.52 万元，归属母公司股东所有者权益合计 100,333.23 万元。2017 年上半年实现营业收入 3,438.75 万元，净利润 488.85 万元，归属母公司股东的净利润-860.64 万元。

(2) 太证非凡投资有限公司，成立于 2016 年 2 月，注册资本 5 亿元，为公司全资子公司。太证非凡注册地为上海市崇明县新河镇新申路 921 弄 2 号 O 区 298 室（上海富盛经济

开发区)，法定代表人为周岚，公司类型为一人有限责任公司（法人独资），统一社会信用代码为 91310230MA1JX6H436。经营范围为：实业投资，投资管理、咨询。

报告期内，太证非凡新增控股子公司 1 家。截至 2017 年 6 月 30 日，太证非凡总资产 98,778.97 万元，净资产 89,809.47 万元，归属母公司股东所有者权益合计 84,763.24 万元。2017 年上半年实现营业收入 665.63 万元，净利润 16.99 万元，归属母公司股东的净利润-52.84 万元。

2、参股子公司

老-中证券有限公司，成立于 2013 年 6 月，注册资本 1,000 亿基普（老挝货币），公司持股比例为 39%。老-中证券注册地为老挝万象市赛色塔县北蓬覃村甘平蒙路老挝证券交易所 6 楼，由公司、老挝农业促进银行和老挝信息产业有限公司合资创建，是经老挝证券管理委员会批准设立的综合类全资质券商，可按老挝《证券法》规定开展所有证券类业务，主要包括：财务顾问、证券经纪及交易代理、证券承销。

截至 2017 年 6 月 30 日，老-中证券总资产 920.73 亿基普（折合人民币 7,362.70 万元），净资产 918.63 亿基普（折合人民币 7,345.92 万元）。2017 年上半年实现营业收入 34.50 亿基普（折合人民币 275.90 万元），净利润 0.83 亿基普（折合人民币 6.67 万元）。

(七) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

1、纳入合并财务报表范围的结构化主体

截至 2017 年 6 月 30 日，公司及子公司作为合伙企业的普通合伙人拥有广东广垦太证现代农业股权投资基金（有限合伙）、太证中投创新（武汉）股权投资基金企业（有限合伙）、北京广垦太证医药投资中心（有限合伙）、北京太证正能股权投资中心（有限合伙）、北京太证恒通股权投资中心（有限合伙）、北京广垦太证投资中心（有限合伙）、北京太证未名股权投资中心（有限合伙）、上海太证洛融投资合伙企业（有限合伙）8 家有限合伙企业完全、独占及排他的管理决策权力，且其他投资方也无权撤销此管理决策权，公司能够对其实施控制，因此将此 8 家合伙企业纳入合并范围。

按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》的规定，公司将公司为管理人且以自有资金参与、所承担的收益（或损失）与产品收益相关的可变回报重大、并满足 2014 年新修订企业会计准则规定“控制”定义的结构化主体太平洋红珊瑚稳盈债券分级集合资产管理计划、太平洋证券红珊瑚智汇 1 号分级集合资产管理计划、太平洋浦银 1 号分级集合资产管理计划、太平洋证券红珊瑚智汇 12 号分级集合资产管理计划，共 4 只集合资产管理计划产品纳入合并报表范围。

2、未纳入合并财务报表范围的结构化主体

公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括公司发起设立的资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。公司所承担的与产品收益相关的可变回报并不重大，因此未合并此类产品。详细情况索引财务报表附注。

二、其他披露事项

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

适用 不适用

(二) 可能面对的风险

适用 不适用

1、影响公司业务经营活动的各项重大风险因素

可能对公司未来发展战略和经营目标的实现产生不利影响的风险因素主要包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险及其他风险。

(1) 市场风险

市场风险是指所持有的金融工具的公允价值因市场价格波动而波动，并使公司遭受非预期经济损失的可能性。市场风险可以按照市场价格类型，划分为股价风险、利率风险、汇率风险和商品价格风险。公司面临的市场风险主要是股价风险和利率风险。公司因持有股票等权益类证券及其衍生品而面临股价风险。公司因持有债券类投资等非权益类证券及其衍生品而面临利率风险。报告期末，公司自营股票和债券持仓规模分别为 145,200.07 万元和 639,469.25 万元。按照报告期末权益类证券持仓规模及配置测算，在 95% 的概率下，1 日最大亏损不超过 2,234.44 万元。

(2) 信用风险

信用风险是指因借款人或者交易对手未能履行有关契约中约定的义务而使公司遭受经济损失的可能性。公司主要因持有债券类投资和从事证券融资类业务而面临信用风险。

债券类投资的信用风险敞口

单位：万元 币种：人民币

类型	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
中国主权信用	9,188.53	9,620.01
AAA 级	122,199.63	37,653.48
AAA 级以下，AA 级（含）以上	239,184.74	80,237.13
AA 级以下，BBB 级（含）以上	2,463.58	2,506.23

BBB 级以下	0.00	0.00
非权益类基金	266,432.77	214,183.46
合计	639,469.25	344,200.32

注：中国主权信用包括国债、中央银行票据、国开债、政策性金融债、政府支持机构债券、地方政府债。

证券融资类业务的信用风险敞口

单位：万元 币种：人民币

类型	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
融资融券	208,596.56	222,585.87
约定式购回	2,281.80	2,281.80
股票质押式回购	919,372.77	1,011,916.99
合计	1,130,251.13	1,236,784.67

(3) 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。公司坚持资金的统一管理和运作，持续加强资金管理体系的建设，由资金运营部统一进行公司资金管理工作。公司通过建立业务资金计划管理机制，对业务资金和规模进行分析、逐日流动性监管指标计算和债务到期分布分析等方式，确定公司在不同时期所需的资金规模和期限结构，通过长短期搭配的融资方式进行资金储备。重视并保持与各个银行和同业机构之间的合作关系，积极扩充融资渠道，使公司的整体流动性保持在较为安全的状态。报告期末，公司流动性覆盖率监管指标为 164.85%，净稳定资金率监管指标为 124.99%，均高于监管要求。

(4) 操作风险

操作风险是指由于内部程序、人员和系统的不完备或失效而遭受损失的可能性。公司经营的每一个环节都可能发生操作风险事件，包括但不限于进行未经授权或者超出权限的交易、玩忽职守、虚报或者隐瞒必要信息、不恰当地使用或者披露保密信息等。比较典型的一类操作风险是信息技术风险，即：公司的信息技术系统可能由于电力故障、通信中断、硬件设施、病毒入侵、软件程序、行业服务商支持能力、操作流程以及自然灾害等方面的因素出现运行故障，使公司遭受经济损失和（或）其他损失。

(5) 合规风险

合规风险是指因未能遵循有关法律、规则和准则，而遭受法律制裁或监管处罚、重大财务损失或声誉损失的可能性。证券行业受到非常严格的监管，公司已经采取应有的措施来防范合规风险，但不能完全排除出现不合规情形的可能性，并可能因此受到警告、罚款、没收违法所得、撤销相关业务许可、责令关闭等行政处罚，或者被监管机构采取限制业务活动等监管措施。

(6) 其他风险

其他风险是指公司面临的未能归于上述风险类型的风险。例如，公司在从事证券经纪、投资银行、资产管理等业务的过程中，会面临其他金融服务商的竞争，此类竞争可能加剧从而导致公司通过这些业务获取的营业收入减少。又如，公司的各项业务活动以及在这一过程中发生的各类风险事件，可能在公众和各类媒体以各种方式解读的过程中对公司的声誉产生正面的或者负面的影响。再如，国内外财政政策、货币政策等宏观经济政策和其他因素可能导致的中国宏观经济的非预期表现（如经济增长失速、经济结构失衡、通货膨胀或者紧缩加剧等），以及监管机构实施的政策调整、制度变革等措施，会对公司的各项业务产生直接、间接或者潜在的影响。此外，一家或者多家金融机构（尤其是具有系统重要性的金融机构）发生的风险事件，可能通过市场价格、参与者信念、监管者行动等渠道对公司相关业务的规模和收入产生重要影响。

2、已经或计划采取的应对措施

(1) 风险管理组织架构

公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，建立健全全面风险管理体系。董事会、经理层以及全体员工共同参与风险管理，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险等包括洗钱风险在内的各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。

董事会承担全面风险管理的最终责任，履行如下风险管理职责：推进风险文化建设；审议批准公司全面风险管理的基本制度；审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；审议公司定期风险评估报告；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；建立与首席风险官的直接沟通机制等。董事会授权其下设的风险管理委员会履行其部分风险管理职责。

监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经理层对全面风险管理承担主要责任，履行如下风险管理职责：制定风险管理制度，并适时调整；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实，对其进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司设首席风险官负责全面风险管理工作，并按照有关法律法规和自律规则的要求，为首席风险官履职提供充分保障。首席风险官为公司高级管理人员，履行如下职责：督导公司

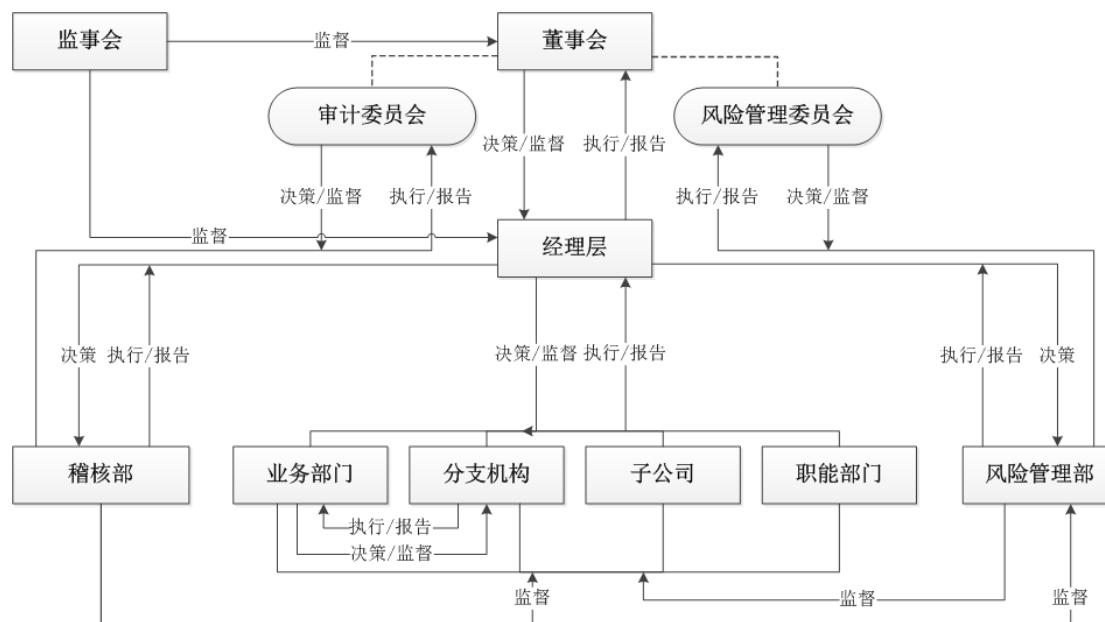
风险管理制度建设；组织实施公司风险管理制度；检查评估公司风险管理制度执行情况；向董事会和经理层报告或者传递风险信息。

风险管理部在首席风险官的领导下，履行如下职责：推动全面风险管理工作；监测、评估、报告公司整体风险水平；为业务决策提供风险管理建议；协助、指导和检查各部门、分支机构和子公司的风险管理工作；向首席风险官报告风险信息。

经理层分别指定了履行流动性风险管理和声誉风险管理职责的具体部门。

各业务部门、分支机构和子公司负责人承担风险管理的直接责任，履行如下风险管理职责：为所负责部门、分支机构或者子公司配备必要的风险管理专业人员；全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险；及时识别、评估、应对和报告相关风险；贯彻落实公司和内部风险管理制度等。

公司将子公司的风险管理纳入统一体系，对其风险管理工作实行垂直管理。



公司风险管理组织架构图

(2) 主要风险管理措施

公司已经、正在并且计划从风险偏好、风险容忍度、风险指标、风险识别、风险评估、风险计量、压力测试、风险监控、风险处置、新业务风险管理等方面，采取一定的措施，防范、管理和控制业务经营活动中面临的各类风险。

对于市场风险、信用风险和流动性风险，公司主要采取设定风险指标、建立止损预警机制和（或）强制止损机制、应用分散化策略等应对措施。公司采取基于风险偏好、风险容忍度和压力测试方法进行风险指标分解的措施，以业务限额的形式限定公司整体的风险暴露水平。公司建立止损预警机制和（或）强制止损机制或者类似机制（如融资融券等信用业务中的预警机制和强制平仓机制），对单一头寸可能造成的损失进行控制。公司采取分散化策略，避免将公司对市场风险和信用风险的暴露集中于少数几个客户或者头寸。公司通过逐日计算

流动性监管指标、风险事件应急预案、专项压力测试、现金流缺口预测、日间流动性管理、均衡债务到期分布等方式,防范流动性风险事件的发生。公司可能通过参与股指期货和(或)国债期货交易,对全部或者部分权益类或者固定收益类证券头寸进行套期保值,以转移全部或者部分市场风险。

在操作风险管理方面,公司依照有关法律规定,严格遵循健全性、合理性、制衡性和独立性原则,建立了全面、系统的内部控制政策与程序,制定了涵盖经营管理各个方面的规章制度和操作流程,并在日常经营管理中不断地予以修订完善。公司风险管理部和稽核部独立于各项业务,对各项业务中的关键环节乃至整体运作进行监控、监督和检查。对于信息技术风险,公司将“安全、稳定运行”作为公司信息系统管理的核心工作,对信息系统进行合理规划,建立和整合多层次信息平台,构建集中交易系统的主备结构,采用不同介质双线路的营业部通讯系统,实施业务数据和重要资料的异地备份机制,确保信息系统的安全;建立完善的信息系统应急处理机制,定期或不定期进行应急演练,及时总结经验,提高处理技术事故或故障的能力。

在合规风险管理方面,公司建立了独立于各项业务的合规管理体系,通过合规审查、合规咨询、合规监测、合规检查、合规培训、合规考核等具体合规管理工作,从事前、事中、事后有效防范合规风险,并通过合规管理有效性评估及时发现所存在的问题并予以修正。

在其他风险管理方面,公司加强对宏观环境和行业实践的研究,持续跟踪国内外宏观经济和政策走势,及时采取符合公司长期发展战略和内外外部环境的风险应对措施。

(三) 其他披露事项

适用 不适用

第五节 重要事项

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2016 年度股东大会	2017/03/21	www.sse.com.cn	2017/03/22
2017 年第一次临时股东大会	2017/06/23	www.sse.com.cn	2017/06/24

股东大会情况说明

适用 不适用

二、利润分配或资本公积金转增预案

(一) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
---------	---

三、承诺事项履行情况

(一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与再融资相关的承诺	股份限售	北京华信六合投资有限公司	非公开发行认购的股份自股份上市之日起 60 个月内不得转让	2014 年 4 月 21 日	是	是	不适用	不适用

2014 年 4 月，公司完成非公开发行股票事宜，发行股票 7 亿股。本次发行新增股份于 2014 年 4 月 21 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了登记托管手续。其中，持股 5% 以上的股东华信六合认购的 15,000 万股份自本次发行股份上市之日起 60 个月内不得转让。2014 年 10 月，公司完成 2014 年半年度资本公积金转增股本事宜，每 10 股转增 5 股，转增后华信六合承诺限售的股份增至 22,500 万股。2016 年 9 月，公司完成 2016 年半年度资本公积金转增股本事宜，每 10 股转增 5 股，转增后华信六合承诺限售的股份增至 33,750 万股。

四、聘任、解聘会计师事务所情况

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

经公司 2016 年度股东大会审议通过，续聘立信会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司 2017 年度审计机构，审计费用合计为人民币 115 万元。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

公司对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

适用 不适用

公司对上年年度报告中的财务报告被注册会计师出具“非标准审计报告”的说明

适用 不适用

五、破产重整相关事项

适用 不适用

六、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》规定应当及时披露的涉案金额超过 1000 万元，并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项。其他金额较大的诉讼、仲裁事项详见下文。

(一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

适用 不适用

(二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

报告期内：									
起诉（申请）方	应诉（被申请）方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼（仲裁）基本情况	诉讼（仲裁）涉及金额	诉讼（仲裁）是否形成预计负债及金额	诉讼（仲裁）进展情况	诉讼（仲裁）审理结果及影响	诉讼（仲裁）判决执行情况
太平洋证券股份有限公司	浙江海宁巨铭投资合伙企业（有限合伙）	无	仲裁	2016年7月4日，与浙江海宁巨铭投资合伙企业（有限合伙）因签订的《股票质押式回购交易客户协议》履行引起纠纷，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会申请仲裁。	15,000.00	否	2016年11月1日中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会出具（2016）中国贸仲京（深）裁字第0081号《裁决书》。公司已于2016年12月5日向嘉兴市中级人民法院申请强制执行，目前执行程序尚未终结。	仲裁委裁决浙江海宁巨铭投资合伙企业（有限合伙）向公司支付融资款 15,000 万元及利息、违约金、相关费用。案件审理结果对公司不产生重大影响。	强制执行阶段
太平洋证券股	上海东方国贸投资管	自然人孙寿祥、上	诉讼	2016年7月14日，与上海东方国贸投资管理有限公司、自然	14,443.77	否	2017年1月13日上海市第一中级人民法院出具（2016）沪01民初554号《民事判决书》，公	法院判决上海东方国贸投资管理有限公司向公司偿还全部债务	执行程序已终结

份有限公司	理有限公司、自然人孙寿祥、上海东方国贸有限公司	海东方国贸有限公司	人孙寿祥、上海东方国贸有限公司之间因金融借款合同引起债权债务纠纷，公司向上海市第一中级人民法院提出诉讼申请。		司于判决生效后立即向法院申请强制执行。2017年6月27日上海市第一中级人民法院出具（2017）沪01执181号《执行裁定书》，因被执行人名下暂无财产可供执行，终结本案执行程序，之后发现有可供执行财产的，可再次申请执行。	14,443.77万元及利息、相关费用，孙寿祥、上海东方国贸有限公司对判决书的前三项判决承担连带清偿责任。案件审理结果对公司不产生重大影响。
-------	-------------------------	-----------	--	--	--	--

（三）公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

适用 不适用

（四）其他说明

适用 不适用

七、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况

适用 不适用

八、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

报告期内，公司及相关股东的诚信状况良好，不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

九、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

（一）相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

事项概述	查询索引
公司于2017年2月16日、3月21日分别召开第四届董事会第四次会议、2016年度股东大会，审议通过了《太平洋证券股份有限公司员工持股计划（草案）及摘要》、《关于提请公司股东大会授权董事会办理公司员工持股计划相关事宜的议案》。公司可转换公司债券项目目前仍在推进中，由于上市公司发行新股和员工持股计划的股票来源方式可能存在冲突，因此公司将结合该项目完成情况和证券公司员工持股计划政策，择机继续推进员工持股计划。	具体内容详见公司于2017年2月17日发布的《第四届董事会第四次会议决议公告》（公告编号：临2017-10）、《太平洋证券股份有限公司员工持股计划（草案）及摘要》；2017年3月22日发布的《2016年度股东大会决议公告》（公告编号：临2017-27）。

（二）临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

十、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

2017年4月21日，公司召开第四届董事会第八次会议审议通过了《关于放弃控股子公司股权转让优先认购权暨关联交易的议案》，公司间接控股子公司瑞辰绿能（上海）融资租赁有限公司的参股股东拟将所持10%股权转让给公司关联法人华信六合，导致公司与关联法人构成共同投资关联交易。公司放弃本次股权转让优先认购权。具体情况详见公司于2017

年 4 月 22 日发布的《第四届董事会第八次会议决议公告》（公告编号：临 2017-33）、《关于放弃控股子公司股权转让优先认购权暨关联交易公告》（公告编号：临 2017-34）。2017 年 6 月 12 日，本次股权转让已经完成，瑞辰绿能（上海）融资租赁有限公司的名称同时变更为太证融资租赁有限公司。

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

关联方	关联关系	向关联方提供资金			关联方向上市公司提供资金		
		期初余额	发生额	期末余额	期初余额	发生额	期末余额
大华大陆投资有限公司	关联人（与公司同一董事长）				609	0	609
北京华信六合投资有限公司	参股股东				275	629.20	904.20
太平洋特别并购公司	其他	346.85	302.81	649.66			
合计		346.85	302.81	649.66	884	629.20	1,513.20
关联债权债务形成原因		关联方为设立基金公司存入公司的前期筹备费用或公司为关联方暂时代为支付的费用					
关联债权债务对公司经营成果及财务状况的影响		对公司的经营成果及财务状况无不利影响					

(五) 其他重大关联交易

适用 不适用

(六) 其他

适用 不适用

十一、重大合同及其履行情况

1、托管、承包、租赁事项

适用 不适用

(1) 托管情况

适用 不适用

(2) 承包情况

□适用 √不适用

(3) 租赁情况

□适用 √不适用

2、担保情况

√适用 □不适用

单位：万元 币种：美元

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	0
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	0
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	2,400
报告期末对子公司担保余额合计（B）	2,400
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	2,400
担保总额占公司净资产的比例(%)	1.41
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	0
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）	2,400
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）	0
上述三项担保金额合计（C+D+E）	2,400
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	无
担保情况说明	根据公司 2015 年第二次临时股东大会审议通过的《关于公司实施境内外债务融资及授权的议案》的相关授权，公司全资子公司太证资本下属的上海太证与银行签订《担保协议》，银行同意为其境外全资子公司正奇国际向境外分行申请的累计 2,400 万美元融资开立保函/备用信用证，在限额内承担保证责任；同时，上海太证与银行签订《质押合同》，将人民币 15,000 万元和 3,000 万元两笔定期存款单出质给银行，为上述保函提供担保。如因汇率波动导致担保不足，上海太证将补充保证金金额。截至报告期末，公司及全资子公司累计提供对外担保总额 2,400 万美元，占公司 2016 年 12 月 31 日经审计净资产的 1.41%。具体情况详见公司于 2017 年 1 月 11 日、2017 年 6 月 21 日发布的《关于全资子公司为其境外全资子公司提供担保的公告》（公告编号：临 2017-03、临 2017-64）。公司不存在其他对外担保事项及逾期担保事项。

3、其他重大合同

□适用 √不适用

十二、上市公司扶贫工作情况

√适用 □不适用

1、精准扶贫规划

公司在 2017 年上半年的扶贫攻坚工作中，积极响应中国证监会及中国证券业协会对开展扶贫攻坚工作的各项要求，落实结对帮扶国家级扶贫县的行动倡议，组织开展“一司一县”结对帮扶工作，充分发挥资本市场中介功能助推扶贫攻坚工作；深入贯彻落实云南省委扶贫开发工作会议精神，认真学习领会扶贫政策，掌握扶贫工作动态。在结对帮扶贫困县中从产业扶贫、教育扶贫、金融扶贫、公益扶贫等方面带动当地群众实现精准脱贫。在 2016 年的工作基础上，公司计划在 2017 年精准扶贫中投入教育扶贫资金 80 万元，资助贡山县乡村教师和贫困学生；认真推进太平洋证券“爱心暖洋洋”公益扶贫计划，持续推动贡山县教育事业的发展；投入产业扶贫资金 20 万元，帮助贡山县普拉底乡力透底村 38 户贫困户（80 人）发展产业。

2、报告期内精准扶贫概要

（1）认真开展“找问题、补短板、促攻坚”专项行动

为贯彻 2017 年 3 月 23 日云南省脱贫攻坚工作会议精神，公司在今年 4 月份脱贫攻坚问题整改月中，以“找问题、补短板、促攻坚”为主题，对照“两不愁、三保障”标准和“六个精准”要求，集中查找突出问题，调整完善工作措施。

公司驻村扶贫工作队队员到挂联点力透底村 4 个村小组农户家中，认真开展入户调查，协助普拉底乡政府对建档立卡贫困户进行评议和识别。充分发挥农村的基层民主，将识别权通过公开公示的方式交给基层农民群众，让老百姓根据自身“标准”，识别确定的扶贫对象是否符合扶贫标准，以发挥普通民众的监督作用。目前公司在力透底村帮扶贫困户为 38 户，尚未发生错评、漏评现象。

（2）开展对贡山县乡村教师和贫困学生资助工作

资助贡山县乡村教师能力提升培训。公司制定了《太平洋证券资助贡山县乡村教师和贫困高中生实施方案》，资助贡山县高中教师到大理州民族中学、初中教师到下关一中、小学教师到大理州实验完小跟班听课，每期听课时间为高中一个学期，初中、小学为期两个月。2016-2017 学年度，共资助四批 39 名教师进行了培训。

资助贡山县乡村教师和贫困学生。①资助贡山县 50 名优秀教师和贫困教师 25 万元。以每人 5,000 元的资助补贴发放，其中优秀教师 30 人，贫困教师 20 人。②资助贡山县第一中学 56 名贫困高中生 22 万。其中普通高中贫困学生 30 名，特长高中贫困生 26 名。普通高中贫困学生每年 3,000 元/人，特长高中贫困生每年 5,000 元/人。③资助贡山县 20 名贫困中职学生 8 万，每年 4,000 元/人。④自 2009 年起，公司领导与普拉底乡中心校贫困孤儿学生结成“一对一”帮扶关系，每年每位领导给予每位学生 500 元生活资助直到该学生完成 9 年义务教育顺利毕业，2016 年共资助 19 名学生。

开展太平洋证券“爱心暖洋洋”公益扶贫计划。2017年3月1日，为在更大范围内调动更多人的力量参与扶贫献爱心，公司以“坚守与未来”为主题设立太平洋证券“爱心暖洋洋”公益扶贫计划。本次活动以公司微信公众号为载体进行宣传，收到捐款金额 11.15 万元，所筹资金将全部用于贡山县改善乡村教师的办公环境。“爱心暖洋洋”公益扶贫计划是公司业务和公益事业的创新结合，通过活动的开展，持续推动贡山县教育事业的发展。

(3) 羊肚菌种植销售工作

2016年，公司在种植中草药“重楼”和“羊肚菌”两个方案中，经过反复对比，确定种植“羊肚菌”方案，公司投入 20 万元帮助贡山县普拉底乡力透底村 4 个村小组 38 户贫困户种植 22 亩羊肚菌。公司选派的驻村扶贫工作队员，长期驻扎在力透底村扶贫一线，对羊肚菌种植进行监督、维护、管理。2017年3月底完成采收，目前已完成全部销售工作，正对项目成效进行分析，在总结种植经验的基础上，完善制定 2017 年产业扶贫项目实施方案。

(4) 发挥资本市场中介功能助推扶贫攻坚工作

按照中国证监会发布《关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》和中国证券业协会下发的《关于证券公司落实精准扶贫工作有关事项的通知》要求，公司积极响应中国证监会及中国证券业协会对开展扶贫攻坚工作的各项要求，落实结对帮扶国家级扶贫县的行动倡议，组织开展“一司一县”结对帮扶工作。

2016年12月，公司与湖南省新化县人民政府签订了“一帮一结对子”战略合作协议，通过在新化县直接设立分支机构开展证券业务，为新化县提供全方位、多层次、宽领域的服务，助力新化县脱贫攻坚。2017年3月，中国证券业协会发布了证券公司“一司一县”结对帮扶公告（2017年第一号），将湖南省新化县列入公司“一司一县”结对帮扶县，至此，公司“一司一县”结对帮扶县扩充到两个县。

2016年12月30日，公司全资另类投资子公司太证非凡出资 4,000 万元参与设立太证新化投资控股有限公司，负责落实公司在湖南新化县《战略合作协议》中的扶贫任务。

2017年2月3日，公司作为管理人发行了太平洋证券新水源污水处理服务收费收益权资产支持专项计划。该计划为国内首单 PPP 资产证券化产品，作为一种创新融资方式为社会资本方投资 PPP 项目提供了新的退出渠道，对支持新疆地方基础设施建设具有重要意义。

此外，公司还在国家级贫困县黑龙江省大庆市林甸县为黑龙江同禹药品包装股份有限公司进行新三板股权融资。2016年完成融资金额 6,667.6 万元；截至 2017 年 6 月底，完成融资金额 20,081.41 万元。

(5) 开展“双联系一共建双推进”工作

公司第一党支部支委与力透底村党总支普拉底党支部共同开展“双联系一共建双推进”活动，利用座谈、走访形式与支部中的 7 名贫困党员共同探讨学习扶贫政策，听取大家对党建、扶贫工作的意见及建议。通过活动推动公司党建有机融入到“挂包帮”、“转走访”工作中，拓展和延伸党组织和党员服务范围 and 内涵，实现基层党建与脱贫攻坚互促共赢。

(6) 加强下派扶贫工作人员的培训及管理

公司选派一名有基层工作经验、熟悉了解乡情民情的员工作为扶贫工作人员。在驻村期间，公司要求选派队员严格服从驻村扶贫工作队的日常管理，遵守“八必须”、“八严禁”纪律，并通过电话联系时常了解其思想动态、工作情况。组织选派队员及时参加县、乡培训会议，了解扶贫政策、重要工作任务安排。对选派队员在生活上关心关爱，解除后顾之忧，在工作经费和食宿补助、人身保险等保障措施上做到全部落实到位。

3、报告期内上市公司精准扶贫工作情况表

单位：万元 币种：人民币

指 标	数量及开展情况
一、总体情况	
其中：1.资金	4.01
2.物资折款	4.01
3.帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	80
二、分项投入	
1.产业发展脱贫	
其中：1.1 产业扶贫项目类型	<input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input type="checkbox"/> 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	1
1.4 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	80
4.教育脱贫	
其中：4.2 资助贫困学生人数（人）	95
9.其他项目	
其中：9.1.项目个数（个）	1
9.2.投入金额	4.01
9.4.其他项目说明	2017年3月使用公司员工捐款40134.26元，购买576双运动鞋、576件雨衣送抵普拉底乡中心校。
三、所获奖项（内容、级别）	无

4、后续精准扶贫计划

(1) 在总结分析羊肚菌种植的经验基础上，结合前期到力透底村村民小组实地勘察调研的扶贫产业项目及村民意向，制定2017年产业扶贫项目实施方案。

(2) 对公司2016-2017学年教育扶贫资助的对象进行回访；对公司领导“一对一”帮扶的贫困学生进行跟踪调查。在了解实际帮扶效果基础上，制定2017年的教育帮扶实施方案。

(3) 继续推进贫困户动态管理及遍访工作。按照贡山县委、县政府要求，针对贫困户动态管理，下半年安排扶贫工作队员主要完成三点工作：一是要认真开展建档立卡贫困户信息的核实工作；二是要做好漏评、错退户信息的采集，进一步排查档外贫困户，切实做到应纳进纳，确保建档立卡不留死角、底数清、数据实；三是要规范录入数据，认真审核信息。严格按照贫困户退出的六条标准执行，对错退、漏退贫困户进行核实更正。

(4) 落实 2017 年“转走访”工作。公司领导干部和结对帮扶的党员同志到公司挂联点普拉底乡力透底村与结对帮扶的 38 户贫困户进行入户走访，听取贫困户对帮扶脱贫工作的意见和建议。

(5) 根据中国证监会下发的《关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》和中国证券业协会“一司一县”工作要求，充分利用公司自身专业优势，发挥资本中介的市场功能作用，通过开展投行、资管、固收、直投等业务，支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，服务贫困地区经济发展。

十三、可转换公司债券情况

适用 不适用

十四、属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其子公司的环保情况说明

适用 不适用

十五、其他重大事项的说明

(一) 与上一会计期间相比，会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况、原因及其影响

适用 不适用

(二) 报告期内发生重大会计差错更正需追溯重述的情况、更正金额、原因及其影响

适用 不适用

(三) 其他

适用 不适用

1、2016年6月13日，公司召开2016年第二次临时股东大会审议通过了公开发行A股可转换公司债券的相关议案。公司拟公开发行可转换为公司A股股票的公司债券，发行规模不超过人民币37亿元（含）。2017年2月27日，公司召开第四届董事会第五次会议审议通过了《关于调减A股可转换公司债券发行规模及相应调整发行方案有关条款的议案》等相关议案，对公开发行A股可转换公司债券方案进行调整，将发行规模调减为“不超过人民币17亿元（含）”，原方案中其他条款不作改变。2017年6月23日，公司召开2017年第一次临时股东

大会审议通过了《关于延长公司公开发行A股可转换公司债券股东大会决议有效期的议案》、《关于延长授权董事会全权办理本次公开发行A股可转换公司债券有关事宜有效期的议案》，将本次公开发行A股可转换公司债券相关决议和授权有效期自前次有效期到期之日起延长12个月，至2018年6月13日。该事项尚需得到中国证券监督管理委员会核准。有关本次公开发行可转债的具体情况详见公司发布的相关临时公告，公司将根据可转债相关事项进展情况，及时发布公告。

2、2017年6月23日，公司召开2017年第一次临时股东大会审议通过了《关于变更部分配股募集资金用途的议案》，变更部分募集资金用途，总计不超过1.5亿元。具体内容详见公司于2017年6月8日发布的《关于变更部分配股募集资金用途的公告》（公告编号：临2017-57）。截至报告期末，公司累计使用募集资金4,280,471,500.80元，其中募集资金本金使用4,258,612,706.49元，募集资金本金已全部使用完毕。具体内容详见与本报告同日发布的《关于2017年半年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》（公告编号：临2017-73）。

3、报告期内，公司新设5家证券分公司，分别为海口分公司、郑州分公司、兰州分公司、天津分公司、洛阳分公司；16家证券营业部，分别为北京金融大街证券营业部、余姚四明西路证券营业部、景东建设路证券营业部、福州古田路证券营业部、北京建国门内大街证券营业部、合肥屯溪路证券营业部、昆明北京路证券营业部、北京宣武门外大街证券营业部、上海崇明区石岛路证券营业部、呼和浩特鄂尔多斯东街证券营业部、贵阳中华南路证券营业部、厦门高林中路证券营业部、杭州宁泰路证券营业部、长春红旗街证券营业部、南昌丰和大道证券营业部、石家庄槐安东路证券营业部。

第六节 普通股股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

2、股份变动情况说明

适用 不适用

3、报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响

(如有)

适用 不适用

4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

(二) 限售股份变动情况

适用 不适用

二、股东情况

(一) 股东总数：

截止报告期末普通股股东总数(户)	364,137
------------------	---------

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

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内 增减	期末持股 数量	比例 (%)	持有有限售条 件股份数量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
北京华信六合投资有限公司	0	877,984,575	12.88	337,500,000	质押	625,110,000	境内非国有 法人
大连天盛硕博科技有限公司	0	292,500,000	4.29	0	质押	80,000,000	境内非国有 法人
中央汇金资产管理有限责任公司	0	127,328,370	1.87	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	77,831,750	109,977,342	1.61	0	无	0	国有法人
中国银行股份有限公司－招商中 证全指证券公司指数分级证券投资 基金	-8,723,300	91,005,814	1.34	0	无	0	其他
深圳市天翼投资发展有限公司	0	64,649,293	0.95	0	无	0	境内非国有 法人

中国金谷国际信托有限责任公司—金谷招金 3 号证券投资集合资金信托计划	-1,200,000	54,898,414	0.81	0	无	0	其他
嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划	0	53,423,760	0.78	0	无	0	其他
北京创博通达科技有限公司	48,586,799	48,586,799	0.71	0	无	0	境内非国有法人
中国工商银行股份有限公司—申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金	-2,034,542	47,213,345	0.69	0	无	0	其他
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量			股份种类及数量			
				种类	数量		
北京华信六合投资有限公司	540,484,575			人民币普通股	877,984,575		
大连天盛硕博科技有限公司	292,500,000			人民币普通股	292,500,000		
中央汇金资产管理有限责任公司	127,328,370			人民币普通股	127,328,370		
中国证券金融股份有限公司	109,977,342			人民币普通股	109,977,342		
中国银行股份有限公司—招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	91,005,814			人民币普通股	91,005,814		
深圳市天翼投资发展有限公司	64,649,293			人民币普通股	64,649,293		
中国金谷国际信托有限责任公司—金谷招金 3 号证券投资集合资金信托计划	54,898,414			人民币普通股	54,898,414		
嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划	53,423,760			人民币普通股	53,423,760		
北京创博通达科技有限公司	48,586,799			人民币普通股	48,586,799		
中国工商银行股份有限公司—申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金	47,213,345			人民币普通股	47,213,345		
上述股东关联关系或一致行动的说明	未知上述股东存在关联关系或存在《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。						

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

适用 不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	北京华信六合投资有限公司	337,500,000	2019 年 4 月 21 日	0	非公开发行认购的股份自股份上市之日起 60 个月内不得转让
上述股东关联关系或一致行动的说明		未知上述股东存在关联关系或存在《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。			

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

三、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

第七节 优先股相关情况

适用 不适用

第八节 董事、监事、高级管理人员情况

一、持股变动情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

姓名	担任的职务	变动情形
许弟伟	董事会秘书	离任
唐卫华	董事会秘书	聘任
史明坤	合规总监兼首席风险官	离任
康 静	合规总监	聘任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

1、因公司经营管理和工作需要，许弟伟先生不再兼任公司董事会秘书职务。经 2017 年 3 月 24 日召开的公司第四届董事会第七次会议审议通过，董事会聘任唐卫华先生担任公司董事会秘书；任期至第四届董事会任期届满之日止。

2、因公司经营管理和工作需要，史明坤先生不再兼任公司合规总监、首席风险官职务。经 2017 年 3 月 24 日召开的公司第四届董事会第七次会议审议通过，董事会聘任康静女士担任合规总监、聘任程绪兰女士担任首席风险官，待取得证券公司高级管理人员任职资格后正式任职，任期至第四届董事会任期届满之日止。康静女士已于 2017 年 4 月 25 日取得证券公司高级管理人员任职资格，2017 年 4 月 30 日起正式任职，并暂代为履行首席风险官职责。

三、其他说明

适用 不适用

第九节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

一、公司债券基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
太平洋证券股份有限公司 2014 年公司债券	14 太证债	122363	2015/3/9	2018/3/9	10	5.28	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2016 年非公开发行公司债券（第一期）	16 太证 01	135479	2016/5/17	2019/5/19	20	4.20	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2016 年次级债券（第 1 期）	16 太证 C1	145001	2016/9/27	2021/9/28	15	4.00	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2016 年次级债券（第 2 期）	16 太证 C2	145260	2016/12/23	2019/12/26	5	5.26	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 1 期）	17 太证 C1	145395	2017/3/14	2020/3/15	9	5.50	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2017 年短期公司债券（第 1 期）	17 太证 D1	145482	2017/4/20	2018/4/21	20	5.50	到期时一次性还本付息	上交所
太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 2 期）	17 太证 C2	145483	2017/4/24	2020/4/25	5	5.50	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所
太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 3 期）	17 太证 C3	145552	2017/5/25	2020/5/26	11	6.20	单利按年计息，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所

公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

2017 年上半年，公司发行的 20 亿元短期公司债券“16 太证 D1”已于 2017 年 4 月到期兑付；56.5 亿元次级债券“15 太证 01”已于 2017 年 6 月全部赎回。“14 太证债”、“16 太证 01”已按时支付利息，“16 太证 C1”、“16 太证 C2”、“17 太证 C1”、“17 太证 D1”、“17 太证 C2”和“17 太证 C3”尚未到兑息期。

公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

公开发行的“14 太证债”没有附发行人或者投资者选择权条款、可交换条款、提前偿还条款等特殊条款。“14 太证债”投资者适当性安排为面向公众投资者发行。

非公开发行的“16 太证 C1”、“16 太证 C2”、“17 太证 C1”、“17 太证 D1”、“17 太证 C2”和“17 太证 C3”均没有附发行人或者投资者选择权条款、可交换条款、提前偿还条款等特殊条款。

非公开发行的“16 太证 01”于第 2 个计息年度付息日附发行人赎回选择权，报告期内未发生相关条款的执行情况。

非公开发行的债券投资者适当性安排均为面向合格机构投资者发行。

二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方

债券受托管理人	名称	信达证券股份有限公司
	办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
	联系人	马军立、周苗
	联系电话	010-63081053
	名称	上海证券有限责任公司
	办公地址	上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼
	联系人	黄凯豪、张林林
	联系电话	021-53686370; 021-53686371
资信评级机构	名称	联合信用评级有限公司
	办公地址	天津市南开区水上公园北道 38 号爱丽园公寓 508

其他说明：

适用 不适用

公司“14 太证债”债券受托管理人为信达证券股份有限公司；“16 太证 01”、“16 太证 C1”、“16 太证 C2”、“17 太证 C1”、“17 太证 D1”、“17 太证 C2”、“17 太证 C3”债券受托管理人上海证券有限责任公司；资信评级机构均为联合信用评级有限公司。

三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

公司于 2015 年 3 月 9 日公开发行公司债券“14 太证债”，募集资金总额 100,000 万元，扣除发行费用 900 万元，募集资金净额 99,100 万元，到账时间为 2015 年 3 月 12 日。根据《太平洋证券股份有限公司公开发行 2014 年公司债券募集说明书》，本次发行债券的募集资金全部用于补充公司营运资金，优化公司资产负债结构。截至 2015 年 3 月 31 日，募集资金全部使用完毕，募集资金的实际使用情况与上述募集资金投向一致，主要用于信用业务及证券投资业务，其中，信用业务 39,317.50 万元，证券投资业务 59,811.06 万元，合计使用募集资金为 99,128.56 万元。实际使用募集资金的金额超过募集资金净额的原因系募集资金在存放期间产生的利息收入减去手续费支出的净额所致。

公司发行的次级债券、短期公司债券和非公开发行公司债券募集资金扣除发行等相关费用后，均用于补充公司营运资金，满足公司中长期及短期业务发展资金需求，资金主要投向为：融资融券业务、股票质押式回购交易业务及证券投资自营业务等。

四、公司债券评级情况

√适用 □不适用

2017 年 4 月 21 日，联合信用评级有限公司（以下简称“联合评级”）对“14 太证债”、“16 太证 01”、“16 太证 C1”和“16 太证 C2”的信用状况进行了跟踪评级，并出具了《太平洋证券股份有限公司公司债券 2017 年跟踪评级报告》（联合【2017】308 号）、《太平洋证券股份有限公司非公开发行公司债券 2017 年跟踪评级报告》（联合【2017】307 号）及《太平洋证券股份有限公司非公开发行次级债券 2017 年跟踪评级报告》（联合【2017】306 号），维持公司发行的“14 太证债”的债项信用等级为 AA+，维持公司主体长期信用等级为 AA+，评级展望维持“稳定”；维持公司发行的“16 太证 01”的债项信用等级为 AA+，维持公司主体长期信用等级为 AA+，评级展望维持“稳定”；维持公司发行的“16 太证 C1”、“16 太证 C2”的债项信用等级为 AA，维持公司主体长期信用等级为 AA+，评级展望维持“稳定”。

2017 年 3 月 6 日，公司聘请了联合评级对“17 太证 C1”发行的资信情况进行评级。根据联合评级出具的《太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 1 期）信用评级报告》（联合【2017】088 号），公司主体长期信用等级为 AA+，债券信用等级为 AA，评级展望为稳定。

2017 年 4 月 11 日，公司聘请了联合评级对“17 太证 D1”发行的资信情况进行评级。根据联合评级出具的《太平洋证券股份有限公司 2017 年短期公司债券（第 1 期）信用评级报告》（联合【2017】264 号），公司主体长期信用等级为 AA+，债券信用等级为 A-1，评级展望为稳定。

2017 年 4 月 11 日，公司聘请了联合评级对“17 太证 C2”发行的资信情况进行评级。根据联合评级出具的《太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 2 期）信用评级报告》（联合【2017】265 号），公司主体长期信用等级为 AA+，债券信用等级为 AA，评级展望为稳定。

2017 年 5 月 9 日，公司聘请了联合评级对“17 太证 C3”发行的资信情况进行评级。根据联合评级出具的《太平洋证券股份有限公司 2017 年次级债券（第 3 期）信用评级报告》（联合【2017】329 号），公司主体长期信用等级为 AA+，债券信用等级为 AA，评级展望为稳定。

五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

√适用 □不适用

根据公司债券募集说明书约定，公司偿债保障措施包括了制定《债券持有人会议规则》、充分发挥债券受托管理人的作用和严格履行信息披露义务等内容。报告期内公司相关计划和措施与募集说明书的相关承诺保持一致。

报告期内，公司按时履行债券年度付息及到期还本付息义务，公司偿债能力良好。

六、公司债券持有人会议召开情况

□适用 √不适用

七、公司债券受托管理人履职情况

√适用 □不适用

公司“14 太证债”债券受托管理人为信达证券股份有限公司，信达证券股份有限公司于 2017 年 3 月 10 日出具了《太平洋证券股份有限公司 2014 年公司债券受托管理事务报告（2016 年度）》。

公司“16 太证 01”债券受托管理人为上海证券有限责任公司，上海证券有限责任公司于 2017 年 3 月 30 日出具了《太平洋证券股份有限公司 2016 年非公开发行公司债券（第一期）受托管理事务报告（2016 年度）》。

公司“16 太证 C1”债券受托管理人为上海证券有限责任公司，上海证券有限责任公司于 2017 年 3 月 30 日出具了《太平洋证券股份有限公司 2016 年次级债券（第 1 期）受托管理事务报告（2016 年度）》。

公司“16 太证 C2”债券受托管理人为上海证券有限责任公司，上海证券有限责任公司于 2017 年 3 月 30 日出具了《太平洋证券股份有限公司 2016 年次级债券（第 2 期）受托管理事务报告（2016 年度）》。

“17 太证 C1”、“17 太证 D1”、“17 太证 C2”和“17 太证 C3”债券受托管理人为上海证券有限责任公司，上述债券于 2017 年发行完毕，均未出具受托管理事务报告。

八、截至报告期末和上年末（或本报告期和上年同期）下列会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年 度末增减（%）	变动原因
流动比率	1.95	2.60	-25.00	卖出回购金融资产款增加， 导致流动负债增加
速动比率	1.95	2.60	-25.00	卖出回购金融资产款增加， 导致流动负债增加
资产负债率	66.67%	65.04%	增加 1.63 个百分点	卖出回购金融资产款增加， 导致流动负债增加
贷款偿还率	100%	100%	-	无逾期未偿还的贷款
	本报告期 (1-6 月)	上年同期	本报告期比上年同 期增减(%)	变动原因
EBITDA 利息保障倍数	0.90	1.37	-34.31	本期营业收入下降所致
利息偿付率	100%	100%	-	无逾期未偿还的利息

九、关于逾期债项的说明

适用 不适用

十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

适用 不适用

2017 年上半年，公司发行的公司债、次级债、短期公司债付息兑付情况详见本节“一、公司债券基本情况”。其他债务融资工具有：融资业务债权收益权转让、股票质押回购式债权收益权转让、收益凭证、同业拆借、法人账户日间透支及债券回购等，各项融资均按时兑付本金及利息。

十一、公司报告期内的银行授信情况

适用 不适用

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共计获得 61 家银行授信，授信总额为 774.1 亿元。报告期内，所有融入资金均按时还本付息。

十二、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用 不适用

报告期内，公司执行了公司债券募集说明书中的承诺：

- 1、募集资金按约定用途使用；
- 2、按期还本付息；
- 3、在约定的场所和时间定期披露公司信息。

十三、公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用 不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

□适用 √不适用

二、财务报表

合并资产负债表

2017年6月30日

编制单位：太平洋证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
资产：			
货币资金	七、1	4,234,806,533.93	6,561,678,339.59
其中：客户存款		3,067,149,514.89	3,436,985,484.77
结算备付金	七、2	1,309,778,184.56	1,702,930,780.52
其中：客户备付金		844,769,519.84	914,078,318.19
拆出资金			
融出资金	七、3	2,080,012,962.56	2,223,610,520.76
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	七、4	9,480,448,649.13	7,563,931,191.26
衍生金融资产	七、5	235,361,670.88	243,444,369.60
买入返售金融资产	七、6	17,284,834,849.52	15,905,348,930.18
应收款项	七、7	73,208,146.13	80,583,891.73
应收利息	七、8	247,001,974.69	158,133,556.76
存出保证金	七、9	66,093,584.67	70,966,887.15
可供出售金融资产	七、10、11	3,698,003,426.67	5,019,377,437.23
持有至到期投资	七、12	117,775,617.42	177,062,112.26
长期股权投资	七、13	70,245,159.14	68,246,606.00
投资性房地产			
固定资产	七、14	284,199,962.24	278,377,724.40
在建工程			
无形资产	七、15	31,873,171.88	33,507,761.58
商誉			
递延所得税资产			
其他资产	七、16	276,509,065.41	277,497,008.56
资产总计		39,490,152,958.83	40,364,697,117.58
负债：			
短期借款			

应付短期融资款	七、18	4,070,000,000.00	4,140,000,000.00
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	七、19	970,724,087.74	1,113,470,014.66
衍生金融负债	七、20	102,563,318.83	91,924,991.52
卖出回购金融资产款	七、21	10,281,640,859.96	5,331,979,081.90
代理买卖证券款	七、22	3,884,222,909.37	4,338,533,169.40
代理承销证券款			
应付职工薪酬	七、23	248,089,095.82	399,300,814.39
应交税费	七、24	47,886,137.32	97,856,176.10
应付款项	七、25	75,327,314.94	50,733,504.38
应付利息	七、26	206,864,677.94	406,033,102.19
预计负债			
长期借款	七、27	162,585,600.00	
应付债券	七、28	7,497,495,800.00	11,745,733,500.00
递延所得税负债	七、29	1,613,741.73	4,241,872.26
其他负债	七、30	73,816,307.21	50,630,210.79
负债合计		27,622,829,850.86	27,770,436,437.59
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	七、31	6,816,316,370.00	6,816,316,370.00
其他权益工具			
资本公积	七、32	2,797,787,668.49	2,797,787,668.49
减：库存股			
其他综合收益	七、33	-102,591,605.79	-95,251,305.16
盈余公积	七、34	332,083,878.41	332,083,878.41
一般风险准备	七、35	664,167,756.82	664,167,756.82
未分配利润	七、36	974,383,839.41	1,302,072,365.83
外币报表折算差额			
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		11,482,147,907.34	11,817,176,734.39
少数股东权益		385,175,200.63	777,083,945.60
所有者权益（或股东权益）合计		11,867,323,107.97	12,594,260,679.99
负债和所有者权益（或股东权益）总计		39,490,152,958.83	40,364,697,117.58

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

母公司资产负债表

2017 年 6 月 30 日

编制单位：太平洋证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	期末余额	期初余额
资产：			
货币资金		3,507,658,984.97	6,332,824,540.31
其中：客户存款		3,067,149,514.89	3,436,985,484.77
结算备付金		1,299,179,897.81	1,706,643,527.93
其中：客户备付金		844,769,519.84	914,078,318.19
拆出资金			
融出资金		2,080,012,962.56	2,223,610,520.76
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		7,846,693,222.59	5,676,756,211.81
衍生金融资产		235,361,670.88	243,444,369.60
买入返售金融资产		17,022,834,574.52	15,397,925,095.18
应收款项		63,556,646.13	65,609,196.44
应收利息		211,999,778.86	114,686,586.43
存出保证金		65,916,237.47	70,544,959.57
可供出售金融资产		3,097,838,560.80	4,131,832,825.16
持有至到期投资		40,253,849.31	40,038,136.99
长期股权投资	八、1	1,828,272,604.81	1,528,246,606.00
投资性房地产			
固定资产		283,970,084.65	277,979,244.46
在建工程			
无形资产		31,873,171.88	33,507,761.58
商誉			
递延所得税资产			
其他资产		237,295,235.21	227,398,051.80
资产总计		37,852,717,482.45	38,071,047,634.02
负债：			
短期借款			
应付短期融资款		4,070,000,000.00	4,140,000,000.00
拆入资金			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
衍生金融负债		102,563,318.83	91,924,991.52
卖出回购金融资产款		10,251,641,159.96	4,989,383,338.15
代理买卖证券款		3,884,222,909.37	4,338,533,169.40

代理承销证券款			
应付职工薪酬		243,378,317.64	394,867,315.71
应交税费		44,251,410.62	94,664,554.17
应付款项		75,327,314.94	50,733,504.38
应付利息		206,886,511.19	405,520,090.33
预计负债			
长期借款			
应付债券		7,497,495,800.00	11,745,733,500.00
递延所得税负债		1,077,712.44	9,540,494.09
其他负债		44,961,302.90	48,765,888.72
负债合计		26,421,805,757.89	26,309,666,846.47
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		6,816,316,370.00	6,816,316,370.00
其他权益工具			
资本公积		2,797,665,028.49	2,797,665,028.49
减：库存股			
其他综合收益		3,233,137.33	24,989,799.41
盈余公积		332,083,878.41	332,083,878.41
一般风险准备		664,167,756.82	664,167,756.82
未分配利润		817,445,553.51	1,126,157,954.42
外币报表折算差额			
所有者权益（或股东权益）合计		11,430,911,724.56	11,761,380,787.55
负债和所有者权益（或股东权益）总计		37,852,717,482.45	38,071,047,634.02

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

合并利润表

2017 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		373,544,122.97	593,975,276.08
手续费及佣金净收入	七、37	269,080,010.38	334,578,845.59
其中：经纪业务手续费净收入		135,838,628.60	199,981,298.13
投资银行业务手续费净收入		41,685,889.01	84,560,189.89
资产管理业务手续费净收入		88,843,766.00	45,546,714.59
利息净收入	七、38	146,219,652.43	162,457,393.02
投资收益（损失以“-”号填列）	七、39	174,745,653.85	100,485,457.81
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		417,932.16	-41,809.76
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	七、40	-217,425,530.45	-4,763,256.72

汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,802,736.56	1,178,801.79
其他收益			
其他业务收入	七、41	2,727,073.32	38,034.59
二、营业支出		457,633,391.81	440,937,709.98
税金及附加	七、42	4,275,465.49	36,609,732.07
业务及管理费	七、43	464,674,711.94	420,971,030.02
资产减值损失	七、44	-11,316,785.62	-16,643,052.11
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		-84,089,268.84	153,037,566.10
加：营业外收入	七、45	5,731,319.86	1,523,294.94
减：营业外支出	七、46	1,017,387.39	38,414.14
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-79,375,336.37	154,522,446.90
减：所得税费用	七、47	33,230,076.24	10,720,272.23
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		-112,605,412.61	143,802,174.67
其中：归属于母公司所有者（或股东）的净利润		-123,199,035.32	146,303,200.09
少数股东损益		10,593,622.71	-2,501,025.42
六、其他综合收益的税后净额	七、48	-21,177,596.78	-6,853,993.15
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-7,340,300.63	-28,003,499.87
（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		-7,340,300.63	-28,003,499.87
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			
2. 可供出售金融资产公允价值变动损益		-7,340,300.63	-28,003,499.87
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		-13,837,296.15	21,149,506.72
七、综合收益总额		-133,783,009.39	136,948,181.52
归属于母公司所有者的综合收益总额		-130,539,335.95	118,299,700.22
归属于少数股东的综合收益总额		-3,243,673.44	18,648,481.30
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）	十九、2	-0.018	0.033
（二）稀释每股收益（元/股）	十九、2	-0.018	0.033

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

母公司利润表

2017 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		345,842,193.84	598,663,355.55
手续费及佣金净收入	八、2	271,681,385.04	334,190,496.13
其中：经纪业务手续费净收入		135,838,628.60	199,981,298.13
投资银行业务手续费净收入		41,685,889.01	84,171,840.43
资产管理业务手续费净收入		89,610,736.14	45,546,714.59
利息净收入	八、3	172,825,084.27	203,239,031.39
投资收益（损失以“－”号填列）	八、4	126,175,768.79	38,649,071.00
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		25,998.81	-41,809.76
公允价值变动收益（损失以“－”号填列）	八、5	-224,510,004.30	22,318,386.23
汇兑收益（损失以“－”号填列）		-330,039.96	266,370.80
其他收益			
其他业务收入			
二、营业支出		422,635,472.22	413,070,936.07
税金及附加		4,011,170.80	36,013,591.06
业务及管理费	八、6	428,309,087.04	393,683,780.28
资产减值损失		-9,684,785.62	-16,626,435.27
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“－”号填列）		-76,793,278.38	185,592,419.48
加：营业外收入		5,235,624.13	1,500,813.86
减：营业外支出		976,379.42	37,644.20
四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）		-72,534,033.67	187,055,589.14
减：所得税费用		31,688,876.14	11,009,789.14
五、净利润（净亏损以“－”号填列）		-104,222,909.81	176,045,800.00
六、其他综合收益的税后净额		-21,756,662.08	-49,191,698.72
（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		-21,756,662.08	-49,191,698.72
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			
2.可供出售金融资产公允价值变动损益		-21,756,662.08	-49,191,698.72
3.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益			
4.现金流量套期损益的有效部分			

5.外币财务报表折算差额			
6.其他			
七、综合收益总额		-125,979,571.89	126,854,101.28
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)		-0.015	0.040
（二）稀释每股收益(元/股)		-0.015	0.040

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

合并现金流量表

2017年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、经营活动产生的现金流量：			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,044,667,907.71	1,022,435,196.65
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		3,579,139,922.11	
融出资金净减少额		144,319,153.96	1,004,073,012.69
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	七、49	96,472,107.19	110,198,345.57
经营活动现金流入小计		4,864,599,090.97	2,136,706,554.91
融出资金净增加额			
代理买卖证券支付的现金净额		447,446,567.41	78,966,591.54
取得以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净减少额		2,107,007,002.13	1,609,384,413.89
支付利息、手续费及佣金的现金		226,410,184.59	185,034,889.60
回购业务资金净减少额			2,257,971,197.10
支付给职工以及为职工支付的现金		457,477,890.91	477,102,763.76
支付的各项税费		114,431,115.26	88,598,180.81
支付其他与经营活动有关的现金	七、49	133,153,003.76	119,712,760.72
经营活动现金流出小计		3,485,925,764.06	4,816,770,797.42
经营活动产生的现金流量净额		1,378,673,326.91	-2,680,064,242.51
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,357,240,956.51	70,000,000.00
取得投资收益收到的现金		113,921,849.41	66,850,995.48
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	七、49	25,288.16	75,251.29
投资活动现金流入小计		1,471,188,094.08	136,926,246.77

投资支付的现金		18,144,785.66	653,882,831.84
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		32,693,750.18	35,395,751.94
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		50,838,535.84	689,278,583.78
投资活动产生的现金流量净额		1,420,349,558.24	-552,352,337.01
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		50,000,000.00	4,258,612,706.49
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		50,000,000.00	
取得借款收到的现金		162,585,600.00	346,605,596.85
发行债券收到的现金		5,019,838,000.00	6,430,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		5,232,423,600.00	11,035,218,303.34
偿还债务支付的现金		9,527,317,428.79	5,700,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		796,038,207.42	984,396,694.27
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		12,346,664.70	3,281,841.29
支付其他与筹资活动有关的现金		606,320,625.11	44,350,000.00
筹资活动现金流出小计		10,929,676,261.32	6,728,746,694.27
筹资活动产生的现金流量净额		-5,697,252,661.32	4,306,471,609.07
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-1,802,736.56	1,178,801.79
五、现金及现金等价物净增加额		-2,900,032,512.73	1,075,233,831.34
加：期初现金及现金等价物余额		8,264,209,120.11	7,472,183,353.68
六、期末现金及现金等价物余额		5,364,176,607.38	8,547,417,185.02

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

母公司现金流量表

2017 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	本期发生额	上期发生额
一、经营活动产生的现金流量：			
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加			
收取利息、手续费及佣金的现金		997,557,255.91	949,577,893.82
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		3,646,312,405.86	
融出资金净减少额		144,319,153.96	1,004,073,012.69
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		64,997,086.58	110,137,877.59

经营活动现金流入小计		4,853,185,902.31	2,063,788,784.10
融出资金净增加额			
代理买卖证券支付的现金净额		447,446,567.41	78,966,591.54
取得以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净减少额		2,390,381,446.95	1,235,004,269.35
支付利息、手续费及佣金的现金		223,351,813.81	181,357,490.24
回购业务资金净减少额			2,364,415,232.10
支付给职工以及为职工支付的现金		437,670,157.48	457,653,035.11
支付的各项税费		134,515,814.31	88,366,008.89
支付其他与经营活动有关的现金		131,748,583.09	116,108,574.51
经营活动现金流出小计		3,765,114,383.05	4,521,871,201.74
经营活动产生的现金流量净额		1,088,071,519.26	-2,458,082,417.64
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,003,685,381.44	70,000,000.00
取得投资收益收到的现金		115,065,945.14	57,144,268.94
收到其他与投资活动有关的现金		23,082.27	75,251.29
投资活动现金流入小计		1,118,774,408.85	127,219,520.23
投资支付的现金		300,000,000.00	993,957,246.95
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		32,658,077.49	35,360,652.94
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		332,658,077.49	1,029,317,899.89
投资活动产生的现金流量净额		786,116,331.36	-902,098,379.66
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			4,258,612,706.49
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		5,019,838,000.00	6,430,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		5,019,838,000.00	10,688,612,706.49
偿还债务支付的现金		9,339,838,000.00	5,700,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		786,495,107.23	924,016,537.03
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计		10,126,333,107.23	6,624,016,537.03
筹资活动产生的现金流量净额		-5,106,495,107.23	4,064,596,169.46
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-330,039.96	266,370.80
五、现金及现金等价物净增加额		-3,232,637,296.57	704,681,742.96
加：期初现金及现金等价物余额		8,039,068,068.24	7,251,998,265.37
六、期末现金及现金等价物余额		4,806,430,771.67	7,956,680,008.33

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

合并所有者权益变动表

2017 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	本期												
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计		
	股本	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	6,816,316,370.00				2,797,787,668.49		-95,251,305.16		332,083,878.41	664,167,756.82	1,302,072,365.83	777,083,945.60	12,594,260,679.99
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	6,816,316,370.00				2,797,787,668.49		-95,251,305.16		332,083,878.41	664,167,756.82	1,302,072,365.83	777,083,945.60	12,594,260,679.99
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）							-7,340,300.63				-327,688,526.42	-391,908,744.97	-726,937,572.02
（一）综合收益总额							-7,340,300.63				-123,199,035.32	-3,243,673.44	-133,783,009.39
（二）所有者投入和减少资本												-376,318,406.83	-376,318,406.83
1. 股东投入的普通股												-376,318,406.83	-376,318,406.83
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											-204,489,491.10	-12,346,664.70	-216,836,155.80
1. 提取盈余公积													
2. 提取一般风险准备													
3. 对所有者（或股东）的分配											-204,489,491.10	-12,346,664.70	-216,836,155.80
4. 其他													
（四）所有者权益内部结转													
1. 资本公积转增资本（或股本）													

2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 其他											
（五）专项储备											
1. 本期提取											
2. 本期使用											
（六）其他											
四、本期期末余额	6,816,316,370.00			2,797,787,668.49		-102,591,605.79	332,083,878.41	664,167,756.82	974,383,839.41	385,175,200.63	11,867,323,107.97

项目	上期											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	股本	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		
优先股		永续债	其他									
一、上年期末余额	3,530,467,026.00			1,825,024,486.00		52,789,038.73		283,559,379.44	567,118,758.88	1,143,461,768.74	571,288,977.34	7,973,709,435.13
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	3,530,467,026.00			1,825,024,486.00		52,789,038.73		283,559,379.44	567,118,758.88	1,143,461,768.74	571,288,977.34	7,973,709,435.13
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,013,743,887.00			3,244,868,639.49		-28,003,499.87				-217,233,672.95	-28,983,179.99	3,984,392,173.68
（一）综合收益总额						-28,003,499.87				146,303,200.09	18,648,481.30	136,948,181.52
（二）所有者投入和减少资本	1,013,743,887.00			3,244,868,639.49							-44,349,820.00	4,214,262,706.49
1. 股东投入的普通股	1,013,743,887.00			3,244,868,639.49							-44,349,820.00	4,214,262,706.49
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										-363,536,873.04	-3,281,841.29	-366,818,714.33

1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准备												
3. 对所有者（或股东）的分配									-363,536,873.04	-3,281,841.29		-366,818,714.33
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
（五）专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
（六）其他												
四、本期期末余额	4,544,210,913.00			5,069,893,125.49		24,785,538.86		283,559,379.44	567,118,758.88	926,228,095.79	542,305,797.35	11,958,101,608.81

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

母公司所有者权益变动表

2017 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

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	6,816,316,370.00				2,797,665,028.49		24,989,799.41		332,083,878.41	664,167,756.82	1,126,157,954.42	11,761,380,787.55
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	6,816,316,370.00				2,797,665,028.49		24,989,799.41		332,083,878.41	664,167,756.82	1,126,157,954.42	11,761,380,787.55
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）							-21,756,662.08				-308,712,400.91	-330,469,062.99

(一) 综合收益总额							-21,756,662.08				-104,222,909.81	-125,979,571.89
(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											-204,489,491.10	-204,489,491.10
1. 提取盈余公积												
2. 对所有者（或股东）的分配											-204,489,491.10	-204,489,491.10
3. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
四、本期期末余额	6,816,316,370.00				2,797,665,028.49		3,233,137.33		332,083,878.41	664,167,756.82	817,445,553.51	11,430,911,724.56

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
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	3,530,467,026.00				1,824,901,666.00		30,351,649.37		283,559,379.44	567,118,758.88	1,150,023,334.69	7,386,421,814.38
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												

二、本年期初余额	3,530,467,026.00				1,824,901,666.00		30,351,649.37		283,559,379.44	567,118,758.88	1,150,023,334.69	7,386,421,814.38
三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列)	1,013,743,887.00				3,244,868,819.49		-49,191,698.72				-187,491,073.04	4,021,929,934.73
(一) 综合收益总额							-49,191,698.72				176,045,800.00	126,854,101.28
(二) 所有者投入和减少资本	1,013,743,887.00				3,244,868,819.49							4,258,612,706.49
1. 股东投入的普通股	1,013,743,887.00				3,244,868,819.49							4,258,612,706.49
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											-363,536,873.04	-363,536,873.04
1. 提取盈余公积												
2. 对所有者(或股东)的分配											-363,536,873.04	-363,536,873.04
3. 其他												
(四) 所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本(或股本)												
2. 盈余公积转增资本(或股本)												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 其他												
(五) 专项储备												
1. 本期提取												
2. 本期使用												
(六) 其他												
四、本期期末余额	4,544,210,913.00				5,069,770,485.49		-18,840,049.35		283,559,379.44	567,118,758.88	962,532,261.65	11,408,351,749.11

法定代表人：李长伟

主管会计工作负责人：周岚

会计机构负责人：曹奕

三、公司基本情况

1、公司概况

√适用 □不适用

太平洋证券股份有限公司的前身为太平洋证券有限责任公司。经中国证监会《关于化解云南证券有限责任公司风险及筹建太平洋证券有限责任公司的函》（证监机构字〔2003〕125号）、《关于同意太平洋证券有限责任公司开业的批复》（证监机构字〔2003〕264号）批准，太平洋证券有限责任公司于2004年1月6日正式注册成立，注册资本6.65亿元，为综合类证券公司。

经中国证监会核准，2007年2月13日，公司注册资本由人民币6.65亿元增至13.98亿元，2007年4月10日，太平洋证券有限责任公司变更为太平洋证券股份有限公司，注册资本为人民币1,401,313,349元，同时增资1.02亿元，公司的注册资本增至人民币1,503,313,349元，增资行为均已经中和正信会计师事务所有限公司（现已并入立信会计师事务所（特殊普通合伙））审验，并分别于2007年1月25日出具中和正信验字[2007]第1—002号验资报告，2007年4月9日出具中和正信验字[2007]第1—010号、中和正信验字[2007]第1—011号验资报告。2012年7月10日，公司以未分配利润按每10股送1股的比例送股，注册资本增至人民币1,653,644,684元，2014年4月21日，公司非公开发行股票70,000万股，募集资金总额为375,900万元人民币，注册资本增至2,353,644,684元，2014年10月15日，公司以公积金转增股本，注册资本增至3,530,467,026元，变更验资报告已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并分别于2012年7月25日出具信会师报字[2012]第210568号验资报告，2014年4月17日出具信会师报字[2014]第210583号验资报告，2014年10月15日出具信会师报字[2014]第211311号验资报告。2016年1月14日，公司按照收市后公司总股本3,530,467,026股为基数，按每10股配3股的比例进行配股，注册资本增至4,544,210,913元，2016年9月26日，公司以资本公积金转增股本，全体股东每10股转增5股，共计转增2,272,105,457股，注册资本增至6,816,316,370元，变更验资报告已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验，分别于2016年1月25日出具信会师报字[2016]第210018号验资报告，2016年9月29日出具信会师报字[2016]第211755号验资报告。

2007年12月28日，公司在上海证券交易所上市。截至报告期末，公司共有102家分支机构，其中18家分公司、84家证券营业部。

截至报告期末，共有员工1,931人，其中高级管理人员8人。

公司注册地及总部地址：云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

统一社会信用代码：91530000757165982D

法定代表人：李长伟

2、合并财务报表范围

√适用 □不适用

截至 2017 年 6 月 30 日，公司合并财务报表范围内子公司如下：

子公司名称
太证资本管理有限责任公司
太证非凡投资有限公司
上海太证投资管理有限公司
西藏太证投资有限公司
西藏正奇投资有限公司
湖北太证投资管理有限公司
太证融资租赁有限公司
太证国际控股有限公司 BVI
正奇国际控股有限公司 BVI
静远国际控股有限公司 BVI
广东广垦太证股权投资基金管理有限公司
宁波甬隆股权投资有限公司
嘉兴太证锦苑投资管理有限公司
广西中垦太证基金管理有限公司

除上表外，合并财务报表范围还包括结构化主体，具体内容详见“附注九、合并范围的变更及附注十、在其他主体中的权益”。

四、财务报表的编制基础

1、编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布《企业会计准则—基本准则》和其他各项具体会计准则、应用指南及准则解释的规定进行确认和计量，在此基础上根据相关披露规定编制财务报表。编制符合企业会计准则要求的财务报表需要使用估计和假设，这些估计和假设会影响到财务报告日的资产、负债和或有负债的披露，以及报告期间的收入和费用。

2、持续经营

√适用 □不适用

公司规范经营，持续扩大业务规模，具有稳定的现金流，可以从多种渠道筹集资金支持公司发展，因此公司具有较强的持续经营能力。

五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

适用 不适用

公司金融工具的核算、证券承销业务的核算、资产管理业务的核算、收入的确认和计量等交易和事项的会计政策和会计估计，是根据公司实际业务特点制定的。

1、遵循企业会计准则的声明

公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况、经营成果、股东权益变动和现金流量等有关信息。

2、会计期间

公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3、营业周期

适用 不适用

公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

4、记账本位币

公司的记账本位币为人民币。

5、同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

(1)、同一控制下的企业合并

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在被合并方资产、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

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。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。

(3)、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。

6、合并财务报表的编制方法

适用 不适用

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（包括公司所控制的单独主体）均纳入合并财务报表。

公司合并财务报表按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》及相关规定的要求编制，合并时合并范围内的所有重大内部交易和往来款已抵销。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。

子公司与公司采用的会计政策或会计期间不一致的，在编制合并财务报表时，按照公司的会计政策或会计期间对子公司财务报表进行必要的调整。

7、现金及现金等价物的确定标准

现金，是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。

现金等价物，是指公司持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

8、外币业务和外币报表折算

适用 不适用

(1)、外币业务

公司外币业务采用分账制。发生外币业务时，分别以不同的币种按照原币记账，资产负债表日，分别以货币性项目和非货币性项目进行处理，货币性项目按资产负债表日即期汇率进行折算，非货币性项目按交易日即期汇率折算；产生的汇兑差额记入当期汇兑损益。

(2)、外币报表折算

公司对合并范围内境外经营实体的财务报表（含采用不同于公司记账本位币的境内子公司、合营企业、联营企业、分支机构等），折算为人民币财务报表进行编报。

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日中国人民银行授权中国外汇交易中心公布的中间价折算；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中国人民银行授权中国外汇交易中心公布的中间价折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日中国人民银行授权中国外汇交易中心公布的中间价折算。折算产生的外币财务报表折算差额，在资产负债表中所有者权益项目下单独列示。外币现金流量采用现金流量发生日中国人民银行授权中国外汇交易中心公布的中间价折算。汇率变动对现金的影响额，在现金流量表中单独列示。处置境外经营时，与该境外经营有关的外币报表折算差额，按比例转入处置当期损益。

9、金融工具

√适用 □不适用

金融工具，是指形成一个企业的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

(1)、金融工具的分类、确认依据和计量方法

公司的金融资产于初始确认时划分为四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项和可供出售金融资产。

公司的金融负债于初始确认时划分为两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

① 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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，包括交易性金融资产和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。公司采用近期出售的投资策略而买入的股票、基金、债券等确认为交易性金融资产。这类金融资产按取得时的公允价值入账，交易费用计入当期损益。支付的价款中包含已宣告尚未发放的现金股利或债券利息，确认为应收项目，持有期间取得的利息或红利，确认为投资收益。期末按公允价值与原账面价值的差额确认公允价值变动损益，计入当期损益。售出时，确认投资收益，同时调整公允价值变动损益。公司售出的交易性金融资产，以加权平均法结转成本。

② 持有至到期投资

指到期日固定、回收金额固定或可确定，且公司有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产，该非衍生金融资产有活跃的市场，可以取得其市场价格。公司对持有至到期投资，按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。支付的价款中包含的已到付息期但尚未领取的债券利息的，单独确认为应收项目。持有至到期投资在持有期间按照摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益。实际利率在取得持有至到期投资时确定，在随后期间保持不变。实际利率与票面利率差别很小的，按票面利率计算利息收入，计入投资收益。处置持有至到期投资时，将所取得价款与该投资账面价值之间的差额确认为投资收益。

③ 贷款和应收账款

贷款和应收款项，是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。对于此类金融资产，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果合同利率与实际利率差异不大，采用合同利率，按摊余成本计量。本公司收回贷款和应收款项时，按取得的价款与贷款和应收款项账面价值之间的差额，确认为当期损益。

④ 可供出售金融资产

指初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，即公司没有划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项的金融资产。

公司可供出售金融资产按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。支付的价款中包含已到付息期但尚未领取的债券利息或已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。公司可供出售金融资产持有期间取得的利息或现金股利，确认为投资收益。可供出售金融资产采用公允价值进行后续计量，在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的，按成本计量。公允价值变动确认为“其他综合收益”。

处置可供出售金融资产时，将取得的价款和该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益，同时，将原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

⑤ 金融资产的重分类

公司改变投资意图或能力发生改变时，将持有至到期投资重分类为可供出售金融资产。持有至到期投资出售或重分类的金额较大，且不属于例外情况，使该投资的剩余部分不再适合划分为持有至到期投资的，公司应当将该投资的剩余部分重分类为可供出售金融资产，且在本会计年度及以后两个完整的会计年度内不得再将该金融资产划分为持有至到期投资。

重分类日，该投资的账面价值与公允价值之间的差额计入所有者权益。

除前段所述两年内不再重新划分类别的可供出售金融资产外，公司因持有意图改变时，可将可供出售金融资产重分类为持有至到期投资。

⑥ 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债指交易性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负债，具体包括：A. 为了近期内回购而承担的金融负债；B. 公司基于风险管理、战略投资需要等，直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；C. 不作为有效套期工具的衍生工具。

公司持有该类金融负债按公允价值计价，不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用。如不适合按公允价值计量时，公司将该类金融负债改按摊余成本计量。

⑦ 其他金融负债

公司的其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。主要包括企业发行的债券、因购买商品产生的应付账款、长期应付款等。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。

公司拥有的其他不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同等，按其公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。在初始计量后按《企业会计准则第 13 号—或有事项》确定的金额，和按《企业会计准则第 14 号—收入》的原则确定的累计摊销额后的余额两者中的较高者进行后续计量。

(2)、金融资产转移的确认依据和计量方法

公司的金融资产转移，包括下列两种情形：

① 收取金融资产现金流量的权利转移给另一方；

② 将金融资产转移给另一方，但保留收取金融资产现金流量的权利，并承担将收取的现金流量支付给最终收款方的义务，同时满足下列条件：

A. 从该金融资产收到对等的现金流量时，才有义务将其支付给最终收款方。企业发生短期垫付款，但有权全额收回该垫付款并按照市场上同期银行贷款利率计收利息的，视同满足本条件。

B. 根据合同约定，不能出售该金融资产或作为担保物，但可以将其作为对最终收款方支付现金流量的保证。

C. 有义务将收取的现金流量及时支付给最终收款方。企业无权将该现金流量进行再投资，但按照合同约定在相邻两次支付间隔期内将所收到的现金流量进行现金或现金等价物投资的除外。企业按照合同约定进行再投资的，应当将投资收益按照合同约定支付给最终收款方。

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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：

① 放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；

② 未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

(3)、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，终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

(4)、金融工具的公允价值确定方法

对于存在活跃市场的金融资产或金融负债，公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。金融工具不存在活跃市场的，采用估值技术确定其公允价值。估值技术的应用中，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，才可以使用不可观察输入值。

对于以公允价值计量的负债，公司已考虑不履约风险，并假定不履约风险在负债转移前后保持不变。不履约风险是指企业不履行义务的风险，包括但不限于企业自身信用风险。

公司对于以公允价值计量的资产和负债，按照其公允价值计量所使用的输入值划分为以下三个层次：

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定。

(5)、金融资产减值测试方法、减值准备计提方法

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产不需要进行减值测试外，其他类的金融资产均应在期末进行减值测试。

① 持有至到期投资的减值准备

持有至到期投资的减值测试采用未来现金流折现法，资产负债表日，对于持有至到期投资，如果按合同或协议没有收到款项或利息，将根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额计算确认减值损失。

② 可供出售金融资产的减值准备

如果可供出售金融资产的发行人或债务人发生严重财务困难，很可能倒闭或进行财务重组等事项，导致资产负债表日单项可供出售金融资产公允价值出现较大幅度下降，超过其持有成本的 50%，并且预期这种下降趋势属于非暂时性，下降时间持续在 12 个月以上的，可认定该可供出售金融资产已发生减值，确认减值损失。可供出售金融资产发生减值的，在确认减值损失时，将原直接计入所有者权益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，计入减值损失。

10、应收款项

(1)、单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项

√适用 □不适用

单项金额重大的判断依据或金额标准	500 万元（含 500 万元）以上
单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法	在资产负债表日，公司应对单项金额 500 万元（含 500 万元）以上的应收款项单独进行减值测试，经测试发生了减值的，按其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确定减值损失，计提坏账准备。

(2)、按信用风险特征组合计提坏账准备的应收款项：

√适用 □不适用

按信用风险特征组合计提坏账准备的计提方法（账龄分析法、余额百分比法、其他方法）	
公司对内部员工的应收款项及合并报表范围内需抵销的往来款	不计提坏账准备
公司对外部单位的应收款项	账龄分析法

组合中，采用账龄分析法计提坏账准备的

√适用 □不适用

账龄	应收账款计提比例(%)	其他应收款计提比例(%)
----	-------------	--------------

1 年以内（含 1 年）	0.5	0.5
1—2 年	10	10
2—3 年	20	20
3 年以上	50	50

组合中，采用余额百分比法计提坏账准备的

适用 不适用

组合中，采用其他方法计提坏账准备的

适用 不适用

(3)、单项金额不重大但单独计提坏账准备的应收款项：

适用 不适用

单项计提坏账准备的理由	如果某项应收款项的可收回性与其他各项应收款项存在明显的差别，导致该项应收款项如果按照账龄分析法及上述标准计提坏账准备无法真实地反映其可收回金额的，将采用个别认定法计提坏账准备。
坏账准备的计提方法	个别认定法

11、长期股权投资

适用 不适用

(1)、初始计量

长期股权投资包括对被投资单位实施控制、重大影响的权益性投资，以及对合营企业的权益性投资。

① 企业合并形成的长期股权投资

通过同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，以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初始投资成本。通过非同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，以合并成本作为初始投资成本。

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。

投资者投入的长期股权投资，按照投资合同或协议约定的价值（扣除已宣告但尚未发放的现金股利或利润）作为初始投资成本，但合同或协议约定价值不公允的除外。

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为基础确定其初始投资成本，除非有确凿证据表明换入资产的公允价值更加可靠；不满足上

述前提的非货币性资产交换,以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为换入长期股权投资

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。

(2)、后续计量及损益确认方法

① 对被投资单位实施控制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,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。

② 对联营企业和合营企业的长期股权投资,采用权益法核算。

长期股权投资的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,不调整长期股权投资的初始投资成本;长期股权投资的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,其差额应当计入当期损益。

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

被投资单位发生的净亏损,以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限,公司负有承担额外损失义务的除外。被投资单位以后实现净利润的,在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后,恢复确认收益分享额。

(3)、确定对被投资单位具有控制、共同控制、重大影响的依据

控制,是指投资方拥有对被投资方的权力,通过参与被投资方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。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;重大影响,是指对一个企业的财务和经营政策有参与决策的权力,但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。

(4)、减值测试方法及减值准备计提方法

资产负债表日,若因市价持续下跌或被投资单位经营状况恶化等原因使长期股权投资存在减值迹象时,根据单项长期股权投资的公允价值减去处置费用后的净额与长期股权投资预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定长期股权投资的可收回金额。长期股权投资的可收回金额低于账面价值时,将资产的账面价值减记至可收回金额,减记的金额确认为资产减值损失,计入当期损益,同时计提相应的资产减值准备。

长期股权投资减值准备一经计提,在资产存续期内不予转回。

12、固定资产

(1)、确认条件

√适用 □不适用

固定资产是指公司为经营管理而持有的使用年限超过 1 年、单位价值在 1,000 元以上的有形资产。

(2)、固定资产的减值测试方法、减值准备计提方法

资产负债表日对固定资产逐项进行分析,对其中由于技术陈旧、损坏、长期闲置等原因,导致其可收回金额低于其账面价值的,采用单项计提法计提固定资产减值准备,减值准备一经计提,在资产存续期内不予转回。

① 除房屋之外的固定资产,由于技术进步、损坏等原因导致其实质上已不可能给公司带来经济利益的,按固定资产报废方式进行固定资产清理。

② 长期闲置不用,且市场公允价值低于该项固定资产账面净值的,按其市场公允价值低于账面价值的差额计提准备。

(3)、其他说明

固定资产的初始计量以成本计价。外购固定资产的成本,包括购买价款、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;自建的固定资产的成本是建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出。

固定资产的后续支出处理原则:与固定资产有关的更新改造等后续支出,符合固定资产确认条件的,应当计入固定资产成本,同时将被替换部分的账面价值扣除;与固定资产有关的修理费用等后续支出,不符合固定资产确认条件的,应当计入当期损益。

当固定资产被处置、或者预期通过使用或处置不能产生经济利益时,终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的金额计入当期损益。

(4)、折旧方法

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限(年)	残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	年限平均法	35	5.00	2.71
电脑及相关设备	年限平均法	5	5.00	19.00
运输设备	年限平均法	8	5.00	11.88
办公设备	年限平均法	8	5.00	11.88
其他设备	年限平均法	5	5.00	19.00

13、在建工程

√适用 □不适用

在建工程成本按实际工程支出确定，包括在建期间发生的各项必要工程支出、工程达到预定可使用状态前的应予资本化的借款费用以及其他相关费用等。在建工程在达到预定可使用状态时转入固定资产。

资产负债表日对在建工程逐项进行分析，对其中可收回金额低于其账面价值的，采用单项计提法计提减值准备。

14、借款费用

√适用 □不适用

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。

15、无形资产

(1)、计价方法

√适用 □不适用

无形资产包括土地使用权、专利技术和非专利技术等。

购入的无形资产，按实际支付的价款和相关的其他支出作为实际成本。

投资者投入的无形资产，按投资合同或协议约定的价值确定实际成本，但合同或协议约定价值不公允的，按公允价值确定实际成本。

通过非货币性资产交换取得的无形资产，具有商业实质且交换涉及的资产的公允价值能可靠计量的，按换出资产的公允价值入账；不具有商业实质或交换涉及的资产的公允价值不能可靠计量的，按换出资产的账面价值入账。

通过债务重组取得的无形资产，按公允价值确定实际成本。

自行研究开发的无形资产，其研究阶段的支出，应当于发生时计入当期损益；其开发阶段的支出，同时满足下列条件的，确认为无形资产（专利技术和非专利技术）：

- A. 完成该无形资产以使其能够使用或出售在技术上具有可行性；
- B. 具有完成该无形资产并使用或出售的意图；
- C. 运用该无形资产生产的产品存在市场或无形资产自身存在市场；

D. 有足够的技术、财务资源和其他资源支持，以完成该无形资产的开发，并有能力使用或出售该无形资产；

- E. 归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量；
- F. 运用该无形资产生产的产品周期在 1 年以上。

(2)、无形资产的摊销方法

使用寿命有限的无形资产,自无形资产可使用时起,在其使用寿命内以直线法进行摊销,摊销金额计入当期损益。来源于合同性权利或其他法定权利的无形资产,其使用寿命按合同或法律规定的最短期限确定;如果合同或法律没有规定使用寿命的,由公司综合各方面的因素判断,以确定无形资产能为公司带来经济利益的期限,无法确定无形资产为公司带来经济利益期限的,则该项无形资产作为使用寿命不确定的无形资产,使用寿命不确定的无形资产不予摊销,于资产负债表日进行减值测试。

交易席位费按照 10 年平均摊销,摊销额计入当期费用。

资产负债表日,对使用寿命有限的无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核,如果有证据表明其使用寿命和摊销方法与前期估计不同时,改变摊销期限和摊销方法。对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核,如果有证据表明其使用寿命是有限的,则按使用寿命有限的无形资产进行摊销。

(3)、无形资产减值准备确认标准、计提方法

当存在下列一项或若干项情况时,公司按无形资产可收回金额低于账面净值的差额计提无形资产减值准备。

- A. 某项无形资产已被其他新技术所替代,使其为企业创造经济利益的能力受到重大不利影响;
- B. 某项无形资产的市价在当期大幅下跌,在剩余摊销年限内预计不会恢复;
- C. 某项无形资产已超过法律保护期限,但仍然具有部分使用价值;
- D. 其他足以证明某项无形资产实质上已经发生减值的情形。

(4)、当存在下列一项或若干项情况时,将该项无形资产的账面价值全部转入当期损益

- A 某项无形资产已被其他新技术所替代,并且该项无形资产已无使用价值和转让价值;
- B. 某项无形资产已超过法律保护期限,并且已不能为企业带来经济利益;
- C. 其他足以证明某项无形资产已经丧失了使用价值和转让价值的情形。

16、长期待摊费用

适用 不适用

经营租赁方式租入的固定资产发生的改良支出按租赁合同期限与 5 年孰短年限平均摊销,其他长期待摊费用项目按费用项目的受益期平均摊销,但最长不得超过 10 年。

17、附回购条件的资产转让

√适用 □不适用

(1)、买入返售证券业务

对于买入返售证券业务，公司根据协议买入金融资产时，按实际支付的金额确认为买入返售金融资产。资产负债表日，按照商定利率计算确定的买入返售金融资产的利息收入确认为当期收入，或按买入价与返售价之间的差额在协议期内计算利息收入确认为当期收入。

(2)、卖出回购证券业务

对于卖出回购证券业务，公司根据回购协议在卖出证券时，按实际收到的金额确认为卖出回购金融资产款。资产负债表日，按照商定利率计算确定的卖出回购金融资产款的利息支出确认为当期成本，或按售价与回购价之间的差额在协议期内计算利息支出认为当期成本。

(3)、买入返售业务减值准备

公司在资产负债表日，对已形成风险的融资类业务所形成的债权，先按照个别认定法，单独进行减值测试，计提相应的减值准备；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计提减值准备，计提比例为约定购回业务 0.8%、质押回购业务 1%。

18、职工薪酬

本公司的职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利和其他长期福利。

(1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

短期薪酬主要包括职工工资、津贴和补贴、奖金、职工福利、医疗保险费、工伤保险费、生育保险费、住房公积金、工会经费、职工教育经费，短期带薪缺勤，非货币性福利及其他短期薪酬等，在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

离职后福利主要包括养老保险费、失业保险费等，按照公司承担的风险和义务，分类为设定提存计划。对于设定提存计划在根据在资产负债表日为换取职工在会计期间提供的服务而向单独主体缴存的提存金确认为负债，并按照受益对象计入当期损益或相关资产成本。

(3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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。

19、预计负债

√适用 □不适用

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，并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。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。公司于资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，如有变化，对账面价值进行调整以反映当前最佳估计数。

20、股份支付

√适用 □不适用

(1)、股份支付的种类

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。

(2)、权益工具公允价值的确定方法

对于授予的存在活跃市场的期权等权益工具，按照活跃市场中的报价确定其公允价值。对于授予的不存在活跃市场的期权等权益工具，采用期权定价模型等确定其公允价值，选用的期权定价模型考虑以下因素：① 期权的行权价格；② 期权的有效期；③ 标的股份的现行价格；④ 股价预计波动率；⑤ 股份的预计股利；⑥ 期权有效期内的无风险利率。

在确定权益工具授予日的公允价值时，考虑股份支付协议规定的可行权条件中的市场条件和非可行权条件的影响。股份支付存在非可行权条件的，只要职工或其他方满足了所有可行权条件中的非市场条件（如服务期限等），即确认已得到服务相对应的成本费用。

(3)、确定可行权权益工具最佳估计的依据

等待期内每个资产负债表日，根据最新取得的可行权职工人数变动等后续信息作出最佳估计，修正预计可行权的权益工具数量。在可行权日，最终预计可行权权益工具的数量与实际可行权数量一致。

(4)、实施、修改、终止股份支付计划的相关会计处理

以权益结算的股份支付，按授予职工权益工具的公允价值计量。授予后立即可行权的，在授予日按照权益工具的公允价值计入相关成本或费用，相应增加资本公积。在完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的，在等待期内的每个资产负债表日，以对可行权权益工具数量的最佳估计为基础，按照权益工具授予日的公允价值，将当期取得的服务计入相

关成本或费用和资本公积。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。

以现金结算的股份支付,按照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,在授予日以公司承担负债的公允价值计入相关成本或费用,相应增加负债。在完成等待期内的服务或达到规定业绩条件以后才可行权的以现金结算的股份支付,在等待期内的每个资产负债表日,以对可行权情况的最佳估计为基础,按照公司承担负债的公允价值金额,将当期取得的服务计入成本或费用和相应的负债。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。

若在等待期内取消了授予的权益工具,公司对取消所授予的权益性工具作为加速行权处理,将剩余等待期内应确认的金额立即计入当期损益,同时确认资本公积。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,公司将其作为授予权益工具的取消处理。

21、收入

适用 不适用

(1)、手续费及佣金收入

① 证券经纪业务收入

代理客户买卖证券的手续费收入,在证券买卖交易日确认收入;手续费收取的依据和标准为根据成交金额及代理买卖的证券品种按相应的费率收取。向基金公司、QFII 等单位提供交易单元确认的收入属于证券经纪业务范畴;代理基金公司等单位销售基金、理财产品等金融资产确认的收入属于证券经纪业务范畴。

② 证券承销业务收入

证券承销收入根据劳务合同条款、发行方式或提供服务的期间按照完工百分比法或其他恰当的方法确认收入。包括采用全额承购包销方式代理发行证券的发行收入,或采用代销方式和余额承购包销方式代理发行证券收取的手续费收入。A. 全额包销方式,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证券承销收入;B. 余额包销、代销方式,代理发行证券的手续费收入在发行期结束后,发行人结算发行价款时,按约定收取的手续费抵减相关发行费用后确认证券承销收入。

③ 证券保荐业务、证券咨询业务收入

按照劳务收入的确认原则,区分提供劳务交易结果能否可靠估计进行确认。公司在资产负债表日提供劳务交易的结果能够可靠估计的,应当采用完工百分比法确认收入;公司在资产负债表日提供劳务交易结果不能可靠估计的,区分已经发生的劳务成本能否得到补偿进行如下处理:A. 已经发生的劳务成本预计能够得到补偿的,应按已收或预计能够收回的金额确

认收入，并结转已经发生的劳务成本；B. 已经发生的劳务成本预计全部不能得到补偿的，应将已经发生的劳务成本计入当期损益，不确认收入。

④ 资产管理业务收入

资产管理业务收入于资产管理合同到期，与委托单位结算时，按合同规定的比例计算应由公司享有的收益或承担的损失，确认为当期的收益或损失；或合同中规定公司按固定比例收取管理费的，则在合同期内分期确认管理费收益。

(2)、利息收入

① 存款利息收入：在相关的收入金额能够可靠地计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和实际利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

② 买入返售证券收入：在当期到期返售的，按返售价格与买入成本价格的差额，确认为当期收入；在当期没有到期的，期末按摊余成本和实际利率计提利息确认为当期收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率确认为当期收入。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。

(3)、投资收益

公司持有交易性金融资产和可供出售金融资产期间取得的红利或现金股利确认为当期收益；处置交易性金融资产时，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损益。处置可供出售金融资产时，将取得的价款和该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益，同时，将原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

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中，按公司应享有的部分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或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

(4)、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。在同时满足，收入的金额能够可靠地计量、相关的经济利益很可能流入公司、交易的完工进度能够可靠地确定、交易中已发生和将发生的成本能够可靠地计量的条件下，按照有关合同或协议约定的收费时间和方法计算确认当期收入。

22、政府补助

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

与资产相关的政府补助，是指企业取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助，包括购买固定资产或无形资产的财政拨款、固定资产专门借款的财政贴息等。

与资产相关的政府补助，确认为递延收益，按照所建造或购买的资产使用年限分期计入营业外收入。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

与收益相关的政府补助，是指除与资产相关的政府补助之外的政府补助。

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。

23、递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

公司所得税的会计核算采用资产负债表债务法核算。所得税包括当期税项和递延税项，当期税项按应纳税所得及适用税率计算，递延税项根据财务报表中资产和负债的账面金额与其用于计算应纳税所得的相应计税基础之间的差额产生的暂时性差异计算。

公司以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限，确认由可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产。对已确认的递延所得税资产，当预计到未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产时，应当减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，减记的金额予以转回。公司未来期间很可能获得足够的应纳税所得额的金额是依据管理层批准的经营计划（或盈利预测）确定。

除下列交易中产生的递延所得税负债以外，公司确认所有应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债：

- ① 商誉的初始确认；
- ② 同时具有下列特征的交易中产生的资产或负债的初始确认：
 - A. 该项交易不是企业合并；
 - B. 交易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）。

资产负债表日，公司对递延所得税资产和递延所得税负债按照税法规定、根据预期收回该资产或清偿该负债期间的税率计量。适用税率发生变化的，对已确认的递延所得税资产和递延所得税负债重新计量，除直接在所有者权益中确认的交易或者事项产生的递延所得税资产和递延所得税负债以外，将其影响数计入变化当期的所得税费用。

24、租赁

(1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

如果租赁条款在实质上将与租赁资产所有权有关的全部风险和报酬转移给承租人，该租赁为融资租赁，其他租赁则为经营租赁。

公司作为出租人时，经营租赁中的租金在租赁期内各个期间按照直线法确认当期损益。发生的初始直接费用，计入当期损益。

公司作为承租人时，经营租赁中的租金在租赁期内各个期间按照直线法计入相关资产成本或当期损益；发生的初始直接费用，计入当期损益。

(2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

公司作为出租人时，在租赁开始日公司按最低租赁收款额与初始直接费用之和作为应收融资租赁款的入账价值，同时记录未担保余值；将最低租赁收款额、初始直接费用及未担保余值之和与其现值之和的差额确认为未实现融资收益。未实现融资收益在租赁期内各个期间采用实际利率法计算确认当期的融资收入。

公司作为承租人时，在租赁开始日公司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，其差额作为未确认融资费用。初始直接费用计入租入资产价值。未确认融资费用在租赁期内各个期间采用实际利率法计算确认当期的融资费用。公司采用与自有固定资产相一致的折旧政策计提租赁资产折旧。

25、融资融券业务

√适用 □不适用

融资融券业务是指证券公司向客户出借资金供其买入证券或出借上市证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。融资融券业务分为融资业务和融券业务两类。

融资业务：公司融出的资金确认应收债权，并确认相应利息收入。融出资金按借给客户资金的本金计量。

融券业务：将自有证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，此项业务融出的证券不终止确认该证券。

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

对客户融资融券并代理客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

公司在资产负债表日，对已形成融资融券业务所形成的债权，先按照个别认定法，单独进行减值测试，计提相应的减值准备；单独测试未发生减值的以及未形成风险的债权，按照资产负债表日融资余额的 0.5% 计提减值准备。

26、其他重要的会计政策和会计估计

√适用 □不适用

(1)、客户交易结算资金核算方法

① 客户交易结算资金与公司自有资金分开核算，并在“货币资金”项目中单设明细科目核算。公司代理客户买卖证券时，由客户将交易结算资金存入存管银行，在客户将资金转入公司银行账户时，公司确定客户存款增加，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

② 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后的金额增加客户交易结算资金。

③ 公司代理客户买卖证券的手续费收入，在证券买卖交易日确认收入。

④ 按照中国人民银行关于活期储蓄存款计息的有关规定，公司对于客户交易结算资金存款按季结息，结息日为每季末月的 20 日，向客户统一结息时，增加客户交易结算资金。

(2)、证券承销核算方法

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，确认为一项资产，公司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。承销期结束后，如有未售出的证券，则按承销价款，转为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或可供出售金融资产。

② 对于以余额包销方式进行代理发行证券的业务，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。发行人结算发行价款时，按约定收取的手续费抵减相关发行费用后确认证券承销收入。承销期结束后，如有未售出的证券，按合同规定由公司认购，则按承销价款，在收到证券时，转为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或可供出售金融资产。

③ 对于以代销方式进行代理发行证券的业务，公司在收到代发行人发售的证券时，只在专设的备查账簿中登记承销证券的情况。代发行证券的手续费收入，在承销业务提供的服务完成时确认为收入。

(3)、代兑付债券核算方法

公司接受客户委托代理兑付其到期债券按兑付方式分为代垫资金兑付和预收资金兑付。兑付的债券和收到的兑付资金分别核算，在向委托单位交付已兑付的债券时，同时冲销代兑付债券项目和代兑付债券款项目。代兑付债券的手续费收入，在代兑付债券基本完成，与委托方结算时确认手续费收入。

(4)、资产管理业务核算方法

客户资产管理业务包括定向资产管理业务（包括银行托管和非银行托管）、集合资产管理业务和专项资产管理业务。

公司受托经营定向非银行托管资产管理业务，按实际受托资产的款项，同时确认为一项资产和一项负债。公司受托经营定向银行托管资产管理业务、集合资产管理业务和专项资产管理计划，以托管客户为主体或集合计划，独立建账，独立核算，定期与托管人的会计核算和估值结果进行复核。

(5)、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。

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。

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。商誉减值损失在发生时计入当期损益，且在以后会计期间不予转回。

(6)、其他综合收益

反映根据企业会计准则规定未在损益中确认的各项利得和损失扣除所得税影响后的净额。

(7)、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。

公司的关联方包括但不限于：

- ① 公司的母公司/实际控制人；
- ② 公司的子公司；
- ③ 与公司受同一母公司控制的其他企业；
- ④ 对公司实施共同控制的投资方；
- ⑤ 对公司施加重大影响的投资方；
- ⑥ 公司的合营企业，包括合营企业的子公司；
- ⑦ 公司的联营企业，包括联营企业的子公司；
- ⑧ 公司的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员；
- ⑨ 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 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。

仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成公司的关联方。

(8)、利润分配

根据公司章程规定，公司当年税后利润分配顺序如下：

- ① 弥补亏损；
- ② 提取法定公积金：按净利润的 10%提取；
- ③ 提取一般风险准备金：按净利润的 10%提取；
- ④ 提取交易风险准备金：按净利润的 10%提取；
- ⑤ 经股东大会决议，还可以提取任意公积金；
- ⑥ 分配股利。

(9)、分部报告

企业以经营分部为基础确定报告分部，经营分部是指公司按照内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定的经营分部，同时满足下列条件的组成部分：

- ① 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

② 企业管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

③ 企业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。

公司的主要分部为证券经纪业务、证券投资业务、投资银行业务、资产管理业务和其他业务。

27、重要会计政策和会计估计的变更

(1)、重要会计政策变更

适用 不适用

(2)、重要会计估计变更

适用 不适用

六、税项

1、主要税种及税率

主要税种及税率情况

适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	应税营业收入	6%、3%
城市维护建设税	应缴流转税额	5%、7%、1%
企业所得税	应纳税所得额	25%、9%、20%
教育费附加	应缴流转税额	3%
地方教育费附加	应缴流转税额	2%、1.5%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

纳税主体名称	所得税税率
西藏太证投资有限公司 ^{注1}	9%
湖北太证投资管理有限公司 ^{注2}	20%

注1：根据《西藏自治区人民政府关于印发西藏自治区企业所得税实施办法的通知（藏政发[2014]51号）》中第三、四条规定执行

注2：根据《关于小型微利企业所得税优惠政策的通知（财税[2015]34号）》中第一点规定执行

2、税收优惠

适用 不适用

3、其他

适用 不适用

(1)、增值税

根据财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及相关附件，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，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。本公司总机构、分支机构及子公司根据增值税纳税人身份分别按照 6%、3% 的税率计算增值税销项税额。

(2)、企业所得税

根据国税发[2012]57 号文《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的通知》，公司实行“统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库”的企业所得税征收管理办法，按照当期实际利润额，总机构和分支机构分期预缴的企业所得税，50%在各分支机构间分摊预缴，50%由总机构预缴。

七、合并财务报表项目注释**1、货币资金**

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
银行存款：	/	/	4,234,325,992.13	/	/	6,544,995,568.51
其中：自有资金	/	/	1,167,176,477.24	/	/	3,108,010,083.74
人民币	/	/	989,372,951.41	/	/	3,082,464,347.45
美元	26,232,835.06	6.7744	177,711,717.83	3,668,893.74	6.9370	25,451,115.72
港元	105,779.33	0.8679	91,808.00	105,779.23	0.8945	94,620.57
客户资金	/	/	3,067,149,514.89	/	/	3,436,985,484.77
人民币	/	/	3,065,491,702.70	/	/	3,434,594,033.82
美元	212,116.16	6.7744	1,436,959.73	302,782.85	6.9370	2,100,404.62
港元	254,461.76	0.8679	220,852.46	325,369.57	0.8945	291,046.33
其他货币资金：	/	/	480,541.80	/	/	16,682,771.08
人民币	/	/	480,541.80	/	/	16,682,771.08
合计	/	/	4,234,806,533.93	/	/	6,561,678,339.59

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额

自有信用资金	/	/	673,628.40	/	/	4,808,408.98
人民币	/	/	673,628.40	/	/	4,808,408.98
客户信用资金	/	/	306,227,759.72	/	/	322,275,169.98
人民币	/	/	306,227,759.72	/	/	322,275,169.98

货币资金的说明

√适用 □不适用

(1) 受限制的货币资金：2017年6月30日受限制的货币资金为180,408,111.11元。其中180,000,000.00元为大额存单，并将存单质押给招商银行，取得招商银行在限额内承担担保责任；408,111.11元为老挝中国银行定期存款。

(2) 2017年6月30日货币资金余额较上期末减少2,326,871,805.66元，减少比例为35.46%，其中公司自有资金减少1,957,035,835.78元，减少比例为62.63%，客户资金减少369,835,969.88元，减少比例为10.76%。主要原因：本期自有资金减少。

2、结算备付金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有备付金：	/	/	356,627,948.24	/	/	633,852,630.51
人民币	/	/	356,627,948.24	/	/	633,852,630.51
客户备付金：	/	/	844,769,519.84	/	/	914,078,318.19
人民币	/	/	831,500,529.85	/	/	895,729,166.65
美元	1,187,069.39	6.7744	8,041,682.84	1,171,107.59	6.9370	8,123,973.35
港元	6,022,798.36	0.8679	5,227,307.15	11,431,038.44	0.8945	10,225,178.19
信用备付金：	/	/	108,380,716.48	/	/	154,999,831.82
人民币	/	/	108,380,716.48	/	/	154,999,831.82
合计	/	/	1,309,778,184.56	/	/	1,702,930,780.52

结算备付金的说明

2017年6月30日结算备付金余额较上期末减少393,152,595.96元，减少比例为23.09%，主要原因：本期末存放在登记结算公司的结算备付金较上期末减少。

3、融出资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
----	--------	--------

个人	2,009,934,586.70	2,154,247,166.38
机构	70,078,375.86	69,363,354.38
合计	2,080,012,962.56	2,223,610,520.76

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
债券	96,595.68	143,058.42
股票	6,002,885,648.46	6,230,595,942.10
基金	7,578,982.23	26,471,026.08
资金	324,121,572.67	325,252,940.81
其他	300,926.34	1,296,750.00
合计	6,334,983,725.38	6,583,759,717.41

融出资金的说明

√适用 □不适用

(1) 按账龄列示

单位：元 币种：人民币

账龄	期末账面余额		期末坏账准备		期初账面余额		期初坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1-3 个月	918,521,796.89	43.94	4,592,608.98	43.94	1,134,828,130.02	50.78	5,674,140.65	50.78
3-6 个月	235,871,720.42	11.28	1,179,358.60	11.28	266,297,174.17	11.92	1,331,485.87	11.92
6 个月以上	936,071,771.70	44.78	4,680,358.86	44.78	833,659,138.78	37.30	4,168,295.69	37.30
合计	2,090,465,289.01	100.00	10,452,326.45	100.00	2,234,784,442.97	100.00	11,173,922.21	100.00

(2) 按业务类别列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
融资融券融出资金	2,090,465,289.01	2,234,784,442.97
减：减值准备	10,452,326.45	11,173,922.21
融出资金净值	2,080,012,962.56	2,223,610,520.76

4、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期	初始投资成本合计

		损益的金融资产			损益的金融资产	
债券	4,675,258,146.16		4,675,258,146.16	4,695,763,114.54		4,695,763,114.54
基金	2,659,585,123.23		2,659,585,123.23	2,660,688,634.93		2,660,688,634.93
股票	1,524,623,740.06		1,524,623,740.06	1,717,050,543.73		1,717,050,543.73
其他	620,981,639.68		620,981,639.68	620,907,151.04		620,907,151.04
合计	9,480,448,649.13		9,480,448,649.13	9,694,409,444.24		9,694,409,444.24
期初余额						
	公允价值			初始投资成本		
项目	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	2,599,592,407.63		2,599,592,407.63	2,599,848,470.07		2,599,848,470.07
基金	2,282,362,264.43		2,282,362,264.43	2,285,774,106.12		2,285,774,106.12
股票	2,258,442,941.80		2,258,442,941.80	2,251,659,145.15		2,251,659,145.15
其他	423,533,577.40		423,533,577.40	422,690,000.00		422,690,000.00
合计	7,563,931,191.26		7,563,931,191.26	7,559,971,721.34		7,559,971,721.34

其他说明

(1) 2017 年 6 月 30 日交易性金融资产余额较上期末增加 1,916,517,457.87 元，增加比例为 25.34%，主要原因：本期末债券投资规模较上期末增加。

(2) 期末交易性金融资产中无已融出证券。

(3) 变现有限制的交易性金融资产：

单位：元 币种：人民币

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	期末金额
交易性权益工具投资	停牌	171,094.00
交易性债券投资	停牌	10,942,161.00
交易性债券投资	卖出回购交易质押	3,043,381,359.50
合计		3,054,494,614.50

5、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债			
权益衍生工具 (按类别列示)												
权益互换			322,792,460.00	235,361,670.88	102,563,318.83			322,792,460.00	243,444,369.60	91,924,991.52		
合计			322,792,460.00	235,361,670.88	102,563,318.83			322,792,460.00	243,444,369.60	91,924,991.52		

6、买入返售金融资产**(1)、按金融资产种类**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	9,307,454,229.97	10,241,860,569.05
债券	8,068,289,157.77	5,763,360,962.74
减：减值准备	90,908,538.22	99,872,601.61
买入返售金融资产账面价值	17,284,834,849.52	15,905,348,930.18

(2)、约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	959,531,207.21	1,088,896,240.65
一个月至三个月内	748,559,260.77	232,908,172.87
三个月至一年内	3,400,072,081.86	3,824,301,871.26
一年以上	4,108,383,141.91	4,995,881,682.66
合计	9,216,545,691.75	10,141,987,967.44

买入返售金融资产的说明：

√适用 □不适用

① 按业务类别列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券	22,818,023.78	22,818,023.78
股票质押式回购	9,193,727,667.97	10,119,169,943.66
银行间市场买断式回购	5,403,382,025.99	3,801,510,883.22
银行间市场质押式回购	119,600,000.00	
交易所质押式回购	2,545,307,131.78	1,961,850,079.52
合计	17,284,834,849.52	15,905,348,930.18

② 担保物情况：2017 年 6 月 30 日公司买入返售金融资产收取的担保物价值为 25,564,581,270.23 元。

7、应收款项**(1)、按明细列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收清算款	17,501,065.03	17,650,876.22
应收财务顾问费		700,000.00
应收定增保证金	9,700,000.00	11,000,000.00
应收投资咨询费	44,515,992.70	48,236,238.42
应收融资融券款	672,235.05	648,202.58
其他	1,956,676.53	3,500,200.00
合计	74,345,969.31	81,735,517.22
减：减值准备	1,137,823.18	1,151,625.49
应收款项账面价值	73,208,146.13	80,583,891.73

(2)、按账龄分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	73,364,826.08	98.68	1,039,708.86	91.38	80,754,373.99	98.80	1,053,511.17	91.48
1-2 年	981,143.23	1.32	98,114.32	8.62	981,143.23	1.20	98,114.32	8.52
2-3 年								
3 年以上								
合计	74,345,969.31	100.00	1,137,823.18	91.38	81,735,517.22	100.00	1,151,625.49	100.00

(3)、按评估方式列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提减值准备	672,235.05	0.90	672,177.62	59.08	648,202.58	0.79	648,145.06	56.28
组合计提减值准备	73,673,734.26	99.10	465,645.56	40.92	81,087,314.64	99.21	503,480.43	43.72
合计	74,345,969.31	100.00	1,137,823.18	100.00	81,735,517.22	100.00	1,151,625.49	100.00

应收款项的说明：

2017 年 6 月 30 日客户未能清偿的融资融券款转入应收账款的金额为 672,235.05 元，单独计提坏账准备。

8、应收利息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
债券投资	141,102,810.98	77,309,011.87
存放金融同业	8,840.16	31,090.53
融资融券	28,148,241.02	32,703,131.21
买入返售	77,742,082.53	48,090,323.15
合计	247,001,974.69	158,133,556.76

应收利息的说明：

2017年6月30日应收利息余额较上期末增加88,868,417.93元，增加比例为56.20%，主要原因：本期末计提的债券利息增加。

期末无逾期的应收利息。

9、存出保证金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
交易保证金	60,792,225.56	65,619,317.69
信用保证金	4,429,967.11	5,152,909.46
期货保证金	871,392.00	194,660.00
合计	66,093,584.67	70,966,887.15

10、可供出售金融资产**(1)、可供出售金融资产情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末				期初			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
债券	949,424,000.00	-1,303,510.00		948,120,490.00	579,424,000.00	-176,580.00		579,247,420.00
基金	361,316,847.04	-99,228,235.01		262,088,612.03	361,316,847.04	-122,417,317.73		238,899,529.31
股票	116,216,903.29	-1,501,554.28		114,715,349.01	183,767,493.33	24,776,322.27		208,543,815.60
银行理财产品	30,000,000.00			30,000,000.00				
资产管理产品	1,728,342,376.36	485,059.49		1,728,827,435.85	1,475,594,518.48	6,598,761.34		1,482,193,279.82
同业存单					325,911,360.00	531,220.08		326,442,580.08
股权投资	614,251,539.78			614,251,539.78	769,726,522.66			769,726,522.66
其他					1,402,550,000.00	11,774,289.76		1,414,324,289.76

合计	3,799,551,666.47	-101,548,239.80		3,698,003,426.67	5,098,290,741.51	-78,913,304.28		5,019,377,437.23
----	------------------	-----------------	--	------------------	------------------	----------------	--	------------------

可供出售金融资产的说明

√适用 □不适用

2017 年 6 月 30 日可供出售金融资产余额较上期末减少 1,321,374,010.56 元，减少比例为 26.33%，主要原因：本期同业存单及其他产品的投资规模减少。

(2)、截至报告期末可供出售金融资产的成本（摊余成本）、公允价值、累计计入其他综合收益的公允价值变动金额，以及已计提减值金额

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

可供出售金融资产分类	可供出售权益工具	可供出售债务工具	合计
权益工具的成本/债务工具的摊余成本	2,850,127,666.47	949,424,000.00	3,799,551,666.47
公允价值	2,749,882,936.67	948,120,490.00	3,698,003,426.67
累计计入其他综合收益的公允价值变动金额	-100,244,729.80	-1,303,510.00	-101,548,239.80
已计提减值金额			

(3)、报告期内可供出售金融资产减值的变动情况

□适用 √不适用

(4)、其他

√适用 □不适用

期末按成本计量的可供出售金融资产

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初金额
股权投资	614,251,539.78	769,726,522.66
合计	614,251,539.78	769,726,522.66

使用受限的可供出售金融资产

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	限制条件
基金	5,861,608.76	已融出
资产管理产品	319,540,559.20	以管理人身份认购的集合理财产品份额，承诺存续期内不退出或维持杠杆比例
合计	325,402,167.96	

11、融券业务情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券		
—可供出售金融资产	5,861,608.76	2,244,735.80
—转融通融入证券		
转融通融入证券总额		

12、持有至到期投资

持有至到期投资情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	77,438,918.79	167,023,975.27
其他	40,336,698.63	10,038,136.99
持有至到期投资合计	117,775,617.42	177,062,112.26
减：持有至到期投资减值准备		
持有至到期投资账面价值	117,775,617.42	177,062,112.26

持有至到期投资的说明：

√适用 □不适用

2017 年 6 月 30 日持有至到期投资余额较上期末减少 59,286,494.84 元，减少比例为 33.48%，主要原因：本期末持有债券规模较上期末减少。

13、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
老一中证券有限公司	28,246,606.00			25,998.81						28,272,604.81	
太证新化投资控股有限公司	40,000,000.00			-195,377.83						39,804,622.17	
武汉光谷人才投资管理有限公司		1,750,000.00		417,932.16						2,167,932.16	
小计	68,246,606.00	1,750,000.00		248,553.14						70,245,159.14	
合计	68,246,606.00	1,750,000.00		248,553.14						70,245,159.14	

其他说明：

联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

14、固定资产

(1)、固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	其他	合计
一、账面原值：					
1.期初余额	250,978,167.89	93,343,058.33	24,196,134.30	381,688.23	368,899,048.75
2.本期增加金额	3,047,619.04	13,017,810.50	854,883.77	28,150.45	16,948,463.76
(1) 购置	3,047,619.04	13,017,810.50	854,883.77	28,150.45	16,948,463.76
3.本期减少金额		3,208,983.91		9,890.00	3,218,873.91
(1) 处置或报废		3,208,983.91		9,890.00	3,218,873.91
4.期末余额	254,025,786.93	103,151,884.92	25,051,018.07	399,948.68	382,628,638.60
二、累计折旧					
1.期初余额	29,426,189.22	42,988,131.88	17,772,037.37	334,965.88	90,521,324.35
2.本期增加金额	3,411,614.96	6,571,825.07	822,602.92	7,004.71	10,813,047.66
(1) 计提	3,411,614.96	6,571,825.07	822,602.92	7,004.71	10,813,047.66
3.本期减少金额		2,896,300.15		9,395.50	2,905,695.65
(1) 处置或报废		2,896,300.15		9,395.50	2,905,695.65
4.期末余额	32,837,804.18	46,663,656.80	18,594,640.29	332,575.09	98,428,676.36
三、减值准备					
四、账面价值					
1.期末账面价值	221,187,982.75	56,488,228.12	6,456,377.78	67,373.59	284,199,962.24
2.期初账面价值	221,551,978.67	50,354,926.45	6,424,096.93	46,722.35	278,377,724.40

(2)、未办妥产权证书的固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
办公用房	50,896,993.79	正在办理产权证书过程中

其他说明：

√适用 □不适用

期末固定资产无所有权的限制。

期末无被用于担保的固定资产。

期末公司对固定资产进行检查，未发现固定资产存在减值迹象，因此未计提固定资产减值准备。

15、无形资产**无形资产情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	软件	交易席位费	合计
一、账面原值			
1.期初余额	83,310,518.59	3,981,150.00	87,291,668.59
2.本期增加金额	7,077,714.19		7,077,714.19
(1) 购置	7,077,714.19		7,077,714.19
3.本期减少金额			
4.期末余额	90,388,232.78	3,981,150.00	94,369,382.78
二、累计摊销			
1.期初余额	50,169,423.58	3,614,483.43	53,783,907.01
2.本期增加金额	8,687,303.87	25,000.02	8,712,303.89
(1) 计提	8,687,303.87	25,000.02	8,712,303.89
3.本期减少金额			
4.期末余额	58,856,727.45	3,639,483.45	62,496,210.90
三、减值准备			
四、账面价值			
1.期末账面价值	31,531,505.33	341,666.55	31,873,171.88
2.期初账面价值	33,141,095.01	366,666.57	33,507,761.58

其他说明：

√适用 □不适用

期末无用于抵押或担保的无形资产。

期末公司对无形资产进行检查，未发现无形资产存在减值迹象，因此未计提无形资产减值准备。

16、其他资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	116,579,822.35	116,993,068.43
预付账款	44,539,080.71	42,510,448.70
待摊费用	14,146,724.65	10,770,197.73
长期待摊费用	21,592,467.24	21,727,460.37
长期应收款	79,650,970.46	85,495,833.33
合计	276,509,065.41	277,497,008.56

其他资产的说明：

(1)、其他应收款

A. 按明细列示

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款余额	134,832,602.42	136,864,368.43
减：坏账准备	18,252,780.07	19,871,300.00
其他应收款净额	116,579,822.35	116,993,068.43

B. 按种类列示

项目	期末账面余额		期末坏账准备		期初账面余额		期初坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项金额重大的应收款项	82,373,682.50	61.09	16,474,736.50	90.26	82,373,682.50	60.19	16,474,736.50	82.91
按组合计提坏账准备的应收款项								
其中：公司内部员工	11,837,083.18	8.78			4,136,254.81	3.02		
公司外部单位	40,621,836.74	30.13	1,778,043.57	9.74	50,354,431.12	36.79	3,396,563.50	17.09
组合小计	52,458,919.91	38.91	1,778,043.57	9.74	54,490,685.93	39.81	3,396,563.50	17.09
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收账款								
合计	134,832,602.42	100.00	18,252,780.07	100.00	136,864,368.43	100.00	19,871,300.00	100.00

C. 单项金额重大单独计提坏账准备的其他应收款

单位名称	账面金额	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
上海东方国贸投资管理有限公司	82,373,682.50	16,474,736.50	20.00	款项存在减值可能
合计	82,373,682.50	16,474,736.50		

D. 组合中按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

账龄	期末账面余额	期末坏账准备	期初账面余额	期初坏账准备
1 年以内	29,322,569.61	146,612.85	25,651,166.69	401,020.57
1-2 年	9,146,695.58	914,669.56	22,491,411.68	2,249,141.17
2-3 年	1,198,415.40	239,683.08	1,198,415.40	239,683.08
3 年以上	954,156.15	477,078.08	1,013,437.35	506,718.68
合计	40,621,836.74	1,778,043.57	50,354,431.12	3,396,563.50

E. 其他应收款金额前五名单位情况

期末应收款项单位名称	金额	款项性质	期限	占应收账款比例 (%)
上海东方国贸投资管理有限公司	82,373,682.50	项目款	2-3 年	61.09
太平洋特别并购公司 (BVI)	6,496,649.60	往来款	1 年以内、1-2 年	4.82
NINEPOINT CAPITAL LLC	2,032,320.00	往来款	1-2 年	1.51

上海中心大厦置业管理有限公司	1,274,855.00	租房押金	1-2 年、3 年以上	0.95
浙江宝龙机械有限公司	1,000,000.00	项目款	1 年以内	0.74
合计	93,177,507.10			69.11
期初应收款项单位名称	金额	款项性质	期限	占应收账款比例(%)
上海东方国贸投资管理有限公司	82,373,682.50	项目款	1-2 年	60.19
陈刚	13,330,000.00	往来款	1-2 年	9.74
太平洋特别并购公司 (BVI)	3,468,500.00	往来款	1 年以内	2.53
NINEPOINT CAPITAL LLC	2,081,100.00	往来款	2-3 年	1.52
上海中心大厦置业管理有限公司	1,068,773.00	租房押金	1-2 年、3 年以上	0.78
合计	102,322,055.50			74.76

(2)、预付账款

预付账款前五名单位情况

单位名称	与本公司关系	金额	款项性质	期限	占预付账款比例(%)
恒生电子股份有限公司	无关联关系	25,810,957.66	软件款	1-2 年	57.95
深圳市财富趋势科技股份有限公司	无关联关系	2,803,709.40	软件款	1-2 年	6.29
北京太和紫金文化发展有限公司	无关联关系	1,920,000.00	宣传款	1-2 年	4.31
云南艺峰装饰有限公司	无关联关系	1,580,785.59	装修款	1 年以内	3.55
上海万得投资管理有限公司	无关联关系	900,000.00	软件款	1-2 年	2.02
合计		33,015,452.65			74.12

(3)、长期待摊费用

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
装修费	8,661,732.98	2,336,014.86	2,475,181.24	8,522,566.60
布线工程	933,096.07	306,951.36	298,230.10	941,817.33
消防工程	191,845.04	651,126.12	128,642.22	714,328.94
机房工程	8,224,605.46		952,087.72	7,272,517.74
网络集成工程		465,045.96	23,252.31	441,793.65
其他	3,716,180.82	254,716.98	271,454.82	3,699,442.98
合计	21,727,460.37	4,013,855.28	4,148,848.41	21,592,467.24

(4)、长期应收款

项目	期末账面价值	期初账面价值
融资租赁款	79,650,970.46	85,495,833.33
其中：未实现融资收益	16,440,196.84	19,330,894.63
合计	79,650,970.46	85,495,833.33

17、资产减值准备变动表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
			转回	转销	
买入返售金融资产减值准备	99,872,601.61		8,964,063.39		90,908,538.22
坏账准备	21,020,983.18		1,631,126.47		19,389,856.71
融出资金减值准备	11,173,922.21		721,595.76		10,452,326.45
合计	132,067,507.00		11,316,785.62		120,750,721.38

18、应付短期融资款

单位：元 币种：人民币

类型	期末账面余额	期初账面余额
收益凭证	2,070,000,000.00	2,140,000,000.00
短期公司债	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
合计	4,070,000,000.00	4,140,000,000.00

19、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			期初公允价值		
	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
其他		970,724,087.74	970,724,087.74		1,113,470,014.66	1,113,470,014.66
合计		970,724,087.74	970,724,087.74		1,113,470,014.66	1,113,470,014.66

其他说明：

2017 年 6 月 30 日以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债较上期末减少 142,745,926.92 元，减少比例为 12.82%，主要原因：公司纳入合并范围内结构化主体产生的应付其他权益持有人持有的权益较上期末减少。

20、衍生金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
收益互换	102,563,318.83	91,924,991.52
合计	102,563,318.83	91,924,991.52

其他说明：

2017年6月30日衍生金融负债余额较上期末增加10,638,327.31元,增加比例为11.57%,主要原因:本期权益互换业务产生的负债较上期末增加。

21、卖出回购金融资产款

按金融资产种类

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	10,251,640,859.96	5,301,979,081.90
其他	30,000,000.00	30,000,000.00
合计	10,281,640,859.96	5,331,979,081.90

卖出回购金融资产款的说明:

√适用 □不适用

2017年6月30日卖出回购金融资产款较上期末增加4,949,661,778.06元,增加比例为92.83%,主要原因:本期末公司卖出回购金融资产规模较上期末增加。

期末卖出回购金融资产款担保物价值为10,759,607,531.98元。

22、代理买卖证券款

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	3,517,702,510.49	3,930,385,832.93
机构	366,520,398.88	408,147,336.47
合计	3,884,222,909.37	4,338,533,169.40

代理买卖证券款的说明:

2017年6月30日代理买卖证券款余额较上期末减少454,310,260.03元,减少比例为10.47%,主要原因:本期末客户交易结算资金余额较上期末减少。

(1)、按币种列示

单位:元 币种:人民币

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	原币	汇率	本币	原币	汇率	本币
人民币	3,872,486,458.89		3,872,486,458.89	4,320,919,721.75		4,320,919,721.75
美元	1,079,970.11	6.7744	7,316,149.51	1,177,795.26	6.9370	8,170,365.72
港币	5,092,982.05	0.8679	4,420,300.97	10,556,709.18	0.8945	9,443,081.93

合计			3,884,222,909.37			4,338,533,169.40
----	--	--	------------------	--	--	------------------

(2)、按客户性质列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务	3,560,101,336.70	4,013,280,228.59
其中：个人客户	3,199,194,189.60	3,607,261,701.03
机构客户	360,907,147.10	406,018,527.56
信用业务	324,121,572.67	325,252,940.81
其中：个人客户	318,508,320.89	323,124,131.90
机构客户	5,613,251.78	2,128,808.91
合计	3,884,222,909.37	4,338,533,169.40

23、应付职工薪酬

(1)、应付职工薪酬列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	399,300,814.39	290,309,260.43	441,520,979.00	248,089,095.82
二、离职后福利-设定提存计划		33,183,492.36	33,183,492.36	
三、辞退福利				
四、一年内到期的其他福利				
合计	399,300,814.39	323,492,752.79	474,704,471.36	248,089,095.82

(2)、短期薪酬列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	392,725,348.99	257,382,670.00	413,058,492.10	237,049,526.89
二、职工福利费		312,693.06	312,693.06	
三、社会保险费		12,206,761.13	12,206,761.13	
其中：医疗保险费		10,984,915.80	10,984,915.80	
工伤保险费		284,776.98	284,776.98	
生育保险费		937,068.35	937,068.35	
四、住房公积金	23,244.00	14,591,963.15	14,615,207.15	
五、工会经费和职工教育经费	6,552,221.40	5,815,173.09	1,327,825.56	11,039,568.93
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	399,300,814.39	290,309,260.43	441,520,979.00	248,089,095.82

(3)、设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险		22,012,643.30	22,012,643.30	
2、失业保险费		1,204,842.54	1,204,842.54	
3、企业年金缴费		9,966,006.52	9,966,006.52	
合计		33,183,492.36	33,183,492.36	

其他说明：

√适用 □不适用

2017年6月30日应付职工薪酬余额较上期末减少151,211,718.57元，减少比例为37.87%，主要原因：本期支付上年度计提的奖金。

高级管理人员报告期内从公司领取的报酬总额为2,761.66万元。

无拖欠性质的应付职工薪酬。

应付职工薪酬发放时间安排：2017年半年末应付工资余额2.48亿元，预计2018年将大部分发放。

24、应交税费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	5,880,944.65	18,828,054.03
企业所得税	6,885,001.49	68,351,060.90
个人所得税	34,396,644.39	8,293,211.21
城市维护建设税	418,050.45	1,328,213.56
教育费附加	303,429.40	950,269.88
其他	2,066.94	105,366.52
合计	47,886,137.32	97,856,176.10

其他说明：

2017年6月30日应交税费余额较上期末减少49,970,038.78元，减少比例为51.06%，主要原因：本期应税收入大幅下降，期末已计提未缴纳的税费相应减少。

25、应付款项**应付款项列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
预收资产管理项目管理费	28,491,806.58	32,760,297.84
应付客户开放式基金清算	43,499,640.01	16,665,601.04
其他	3,335,868.35	1,307,605.50
合计	75,327,314.94	50,733,504.38

其他说明

√适用 □不适用

2017年6月30日应付款项余额较上期末增加24,593,810.56元，增加比例为48.48%，主要原因：本期末应付客户基金赎回款较上期末增加。

26、应付利息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付债券	27,495,890.45	96,241,095.91
卖出回购	15,061,499.80	11,854,293.93
次级债券	85,400,821.93	199,944,657.53
短期融资	21,397,260.27	87,564,561.66
其他	57,509,205.49	10,428,493.16
合计	206,864,677.94	406,033,102.19

应付利息的说明：

2017年6月30日应付利息余额较上期末减少199,168,424.25元，减少比例为49.05%，主要原因：本期偿还上年度计提的部分公司债和次级债利息。

27、长期借款**长期借款分类**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款	162,585,600.00	
合计	162,585,600.00	

其他说明，包括利率区间：

适用 不适用

2017 年 6 月 30 日长期借款较上期末增加 162,585,600.00 元，主要原因：本期子公司借入 2 笔款项，金额共计 2,400 万美元，利率为 3 个月 Libor 基准利率+1.75%，借款期限 3 年。质押物为 1.8 亿元人民币大额存单。

28、应付债券

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	发行日期	债券期限	发行金额	票面利率	期末余额	期初余额
公司债	1,000,000,000.00	2015 年 3 月 9 日	3 年	1,000,000,000.00	5.28%	997,495,800.00	995,733,500.00
次级债	5,650,000,000.00	2015 年 6 月 17 日	3 年	5,650,000,000.00	6.00%		5,650,000,000.00
公司债	2,000,000,000.00	2016 年 5 月 17 日	3 年	2,000,000,000.00	4.20%	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
次级债	1,500,000,000.00	2016 年 9 月 27 日	5 年	1,500,000,000.00	4.00%	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00
次级债	500,000,000.00	2016 年 12 月 23 日	3 年	500,000,000.00	5.26%	500,000,000.00	500,000,000.00
收益凭证	300,000,000.00	2016 年 8 月 26 日	2 年	300,000,000.00	3.90%		300,000,000.00
收益凭证	500,000,000.00	2016 年 10 月 11 日	2 年	500,000,000.00	3.90%		500,000,000.00
收益凭证	300,000,000.00	2016 年 10 月 27 日	2 年	300,000,000.00	3.80%		300,000,000.00
次级债	900,000,000.00	2017 年 3 月 15 日	3 年	900,000,000.00	5.50%	900,000,000.00	
次级债	500,000,000.00	2017 年 4 月 25 日	3 年	500,000,000.00	5.50%	500,000,000.00	
次级债	1,100,000,000.00	2017 年 5 月 26 日	3 年	1,100,000,000.00	6.20%	1,100,000,000.00	
合计	14,250,000,000.00			14,250,000,000.00		7,497,495,800.00	11,745,733,500.00

应付债券说明：

公司于 2016 年 8 月 26 日发行的收益凭证，于 2017 年 1 月 25 日提前赎回；公司于 2016 年 10 月 11 日发行的收益凭证，于 2017 年 2 月 15 日提前赎回；公司于 2016 年 10 月 27 日发行的收益凭证，于 2017 年 2 月 10 日提前赎回。

其他债券情况详见“第九节、公司债券相关情况”。

29、递延所得税资产/ 递延所得税负债

(1)、未经抵销的递延所得税资产

适用 不适用

(2)、未经抵销的递延所得税负债

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债

可供出售金融资产公允价值变动	6,426,673.49	1,606,668.37	11,642,474.80	2,910,618.68
交易性金融资产公允价值变动	28,293.44	7,073.36	5,325,014.33	1,331,253.58
合计	6,454,966.93	1,613,741.73	16,967,489.13	4,241,872.26

(3)、以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

□适用 √不适用

(4)、未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异	178,127,969.01	83,738,797.11
资产减值准备	120,750,721.38	132,067,507.00
合计	298,878,690.39	215,806,304.11

由于公司未来能否获得足够的应纳税所得额具有不确定性，根据谨慎性原则，没有确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异。

(5)、未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

□适用 √不适用

30、其他负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	72,294,509.44	49,108,413.02
代理兑付债券款	1,521,797.77	1,521,797.77
合计	73,816,307.21	50,630,210.79

其他负债的说明：

(1)、其他应付款

单位：元 币种：人民币

项目	期末金额	期末比例(%)	期初金额	期初比例(%)
应付投资者保护基金	5,187,633.12	7.18	14,423,337.59	29.37
应付风险金	3,822,149.12	5.29	3,621,891.25	7.38
应付代扣个人社保款	1,030,977.54	1.43	783,942.32	1.60
应付证券清算款	25,579,214.67	35.38	10,077,237.74	20.52
其他 ^注	36,674,534.99	50.73	20,202,004.12	41.43
合计	72,294,509.44	100.00	49,108,413.02	100.00

注：主要系公司拟参与发起设立基金管理公司，各发起人共同委托本公司以及筹备组为代理人负责组织筹备工作，依据协议存入筹备费用共计 1,963 万元。

(2)、代理兑付债券款

单位：元 币种：人民币

债券种类	期末账面价值	期初账面价值
国债	406,220.34	406,220.34
企业债券	1,115,577.43	1,115,577.43
合计	1,521,797.77	1,521,797.77

31、股本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	6,816,316,370.00						6,816,316,370.00

32、资本公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	2,797,787,668.49			2,797,787,668.49
合计	2,797,787,668.49			2,797,787,668.49

33、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初账面余额	本期发生金额					期末账面余额
		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：重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动							
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	-95,251,305.16	-22,634,935.52	-153,388.43	-1,303,950.31	-7,340,308.26	-13,837,040.15	-102,591,605.79
其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额							
可供出售金融资产公允价值变动损益	-95,251,305.16	-22,634,935.52	-153,388.43	-1,303,950.31	-7,340,308.26	-13,837,040.15	-102,591,605.79
持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益							

现金流量套期损益的有效部分							
外币财务报表折算差额							
其他综合收益合计	-95,251,305.16	-22,634,935.52	-153,388.43	-1,303,950.31	-7,340,308.26	-13,837,040.15	-102,591,605.79

34、盈余公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	332,083,878.41			332,083,878.41
合计	332,083,878.41			332,083,878.41

35、一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	332,083,878.41				332,083,878.41
交易风险准备	332,083,878.41				332,083,878.41
合计	664,167,756.82				664,167,756.82

36、未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	1,302,072,365.83	1,143,461,768.74
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	1,302,072,365.83	1,143,461,768.74
加：本期归属于母公司所有者的净利润	-123,199,035.32	146,303,200.09
减：提取法定盈余公积		
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备		
应付普通股股利	204,489,491.10	363,536,873.04
转作股本的普通股股利		
期末未分配利润	974,383,839.41	926,228,095.79

37、手续费及佣金净收入

(1)、手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额

手续费及佣金收入	318,189,095.28	391,318,635.14
证券经纪业务	175,540,686.56	250,719,631.69
其中：代理买卖证券业务	169,043,479.06	238,039,750.72
交易单元席位租赁	6,268,567.85	10,401,130.01
代销金融产品业务	228,639.65	2,278,750.96
投资银行业务	44,438,063.64	85,748,869.14
其中：证券承销业务	10,901,886.80	34,969,999.99
证券保荐业务	3,018,867.92	943,396.23
财务顾问业务	30,517,308.92	49,835,472.92
资产管理业务	95,037,558.06	49,759,581.07
投资咨询业务	108,354.71	319,741.50
其他	3,064,432.31	4,770,811.74
手续费及佣金支出	49,109,084.90	56,739,789.55
证券经纪业务	39,702,057.96	50,738,333.56
其中：代理买卖证券业务	39,702,057.96	50,738,333.56
投资银行业务	2,752,174.63	1,188,679.25
其中：证券承销业务	2,752,174.63	1,188,679.25
资产管理业务	6,193,792.06	4,212,866.48
其他	461,060.25	599,910.26
手续费及佣金净收入	269,080,010.38	334,578,845.59
其中：财务顾问业务净收入	566,037.74	750,000.00
—并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司		
—并购重组财务顾问业务净收入--其他	566,037.74	750,000.00
—其他财务顾问业务净收入	29,951,271.18	49,085,472.92

(2)、代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	270,445,741.00	228,639.65	51,471,397.89	2,201,600.96
资产管理产品			13,942,192.81	77,150.00
合计	270,445,741.00	228,639.65	65,413,590.70	2,278,750.96

(3)、资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	41	359	2

期末客户数量	26,726	176	23
其中：个人客户	26,557	8	
机构客户	169	168	23
期初受托资金	36,770,773,574.49	124,583,975,917.21	478,000,000.00
其中：自有资金投入	1,103,527,593.43		
个人客户	3,981,235,249.85	127,540,000.00	
机构客户	31,686,010,731.21	124,456,435,917.21	478,000,000.00
期末受托资金	30,654,758,148.09	133,154,917,090.08	1,318,000,000.00
其中：自有资金投入	1,176,338,495.83		
个人客户	6,703,982,452.67	110,000,000.00	
机构客户	22,774,437,199.59	133,044,917,090.08	1,318,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	34,128,045,792.83	127,776,805,603.87	1,361,603,000.00
其中：股票	1,119,861,954.04	2,378,433,280.73	
其他债券	31,812,274,353.76	1,449,645,756.58	
基金	580,359,289.03	2,906,823.20	3,203,000.00
信托计划	412,300,000.00	11,444,885,376.58	
其他	203,250,196.00	112,500,934,366.78	1,358,400,000.00
当期资产管理业务净收入	30,902,448.53	48,032,311.33	1,812,865.98

手续费及佣金净收入的说明：

√适用 □不适用

2017年1-6月手续费及佣金净收入较上年同期减少65,498,835.21元，减少比例为19.58%，主要原因：本期交易量减少，相应经纪业务收入较上年同期减少。

38、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	737,774,721.38	640,096,538.52
存放金融同业利息收入	161,385,179.67	87,747,197.25
其中：自有资金存款利息收入	123,786,358.91	43,996,984.69
客户资金存款利息收入	37,598,820.76	43,750,212.56
融资融券利息收入	83,042,404.21	95,068,892.93
买入返售金融资产利息收入	487,739,138.27	444,992,344.39
其中：约定购回利息收入	1,313,472.39	87,535.57
股权质押回购利息收入	318,960,404.31	406,573,206.17
其他	5,607,999.23	12,288,103.95
利息支出	591,555,068.95	477,639,145.50
客户资金存款利息支出	8,096,722.52	9,500,306.69

卖出回购金融资产利息支出	172,803,900.98	67,867,424.35
短期借款利息支出	82,579,575.03	70,208,431.12
拆入资金利息支出	396,300.01	3,110,358.32
应付债券利息支出	74,356,546.59	39,238,790.41
次级债券利息支出	224,456,164.40	200,104,109.60
其他	28,865,859.42	87,609,725.01
利息净收入	146,219,652.43	162,457,393.02

39、投资收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益		
权益法核算的长期股权投资收益	248,553.14	-41,809.76
处置长期股权投资产生的投资收益	1,559,918.39	
金融工具投资收益	172,937,182.32	100,527,267.57
其中：持有期间取得的收益	186,385,558.89	289,448,403.86
—交易性金融资产	156,810,771.41	210,519,886.88
—持有至到期投资	2,008,634.51	3,848,036.08
—可供出售金融资产	27,566,152.97	75,080,480.90
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	-13,448,376.57	-188,921,136.29
—交易性金融资产	-99,433,571.20	-249,118,747.04
—持有至到期投资		4,798,130.26
—可供出售金融资产	86,327,438.25	55,303,482.38
—衍生金融工具	-342,243.62	95,998.11
合计	174,745,653.85	100,485,457.81

投资收益的说明：

2017年1-6月投资收益较上年同期增加74,260,196.04元，增加比例为73.90%，主要原因：本期股票的投资收益均较上年同期增加。

40、公允价值变动收益 /（损失）

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-217,421,470.45	-4,755,996.72
交易性金融负债		
衍生金融工具	-4,060.00	-7,260.00

合计	-217,425,530.45	-4,763,256.72
----	-----------------	---------------

公允价值变动收益的说明：

2017 年 1-6 月公允价值变动收益较上年同期减少 212,662,273.73 元，主要原因：本期交易性金融资产的公允价值变动较上年同期下降。

41、其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
咨询服务收入		38,034.59
融资租赁收入	2,727,073.32	
合计	2,727,073.32	38,034.59

其他业务收入的说明：

2017 年 1-6 月其他业务收入较上年同期增加 2,689,038.73 元，增加比例为 7069.98%，主要原因：本期新增子公司融资租赁收入。

42、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准	税率
营业税	75,000.00	30,736,375.73	应税营业收入	5%
城市维护建设税	1,828,321.74	3,412,575.90	应缴流转税额	5%、7%、1%
教育费附加	1,313,394.22	2,440,651.93	应缴流转税额	3%、2%、1.5%
其他	1,058,749.53	20,128.51		
合计	4,275,465.49	36,609,732.07	/	

其他说明：

2017 年 1-6 月税金及附加较上年同期减少 32,334,266.58 元，减少比例为 88.32%，主要原因：本期应税收入减少，相应税金较上年同期减少；自 2016 年 5 月 1 日起，金融业纳入营业税改征增值税试点范围，公司由缴纳营业税改为缴纳增值税。

43、业务及管理费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
工资	259,269,969.48	237,496,092.33

职工养老保险金	32,054,028.94	24,283,936.13
租赁费	15,641,507.58	10,800,526.00
住房公积金	14,616,011.15	10,509,000.80
差旅费	14,225,534.10	11,112,695.25
业务招待费	13,463,830.79	14,215,626.36
邮电通讯费	12,666,508.41	6,411,875.71
职工医疗保险金	11,016,211.66	7,725,035.88
折旧费	10,817,537.17	8,456,129.50
咨询费	10,662,968.75	19,941,825.82
其他	70,240,603.91	70,018,286.24
合计	464,674,711.94	420,971,030.02

业务及管理费的说明：

2017 年 1-6 月业务及管理费较上年同期增加 43,703,681.92 元，增加比例为 10.38%，主要原因：本期公司规模增大，各项费用略有增加。

44、资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
一、坏账损失	-1,631,126.47	-22,020,904.42
二、存货跌价损失		
三、可供出售金融资产减值损失		
四、持有至到期投资减值损失		
五、长期股权投资减值损失		
六、投资性房地产减值损失		
七、固定资产减值损失		
八、工程物资减值损失		
九、在建工程减值损失		
十、生产性生物资产减值损失		
十一、油气资产减值损失		
十二、无形资产减值损失		
十三、商誉减值损失		
十四、其他	-9,685,659.15	5,377,852.31
合计	-11,316,785.62	-16,643,052.11

其他说明：

2017 年 1-6 月资产减值损失较上年同期增加 5,326,266.49 元，主要原因：本期收回大额已计提坏账准备的其他应收款，因此冲回上期计提的减值准备。

45、营业外收入

营业外收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计	25,288.16	47.69	25,288.16
其中：固定资产处置利得	25,288.16	47.69	25,288.16
政府补助	3,390,166.00		3,390,166.00
代扣各项税费手续费返还	2,244,628.38	1,484,193.07	2,244,628.38
其他	71,237.32	39,054.18	71,237.32
合计	5,731,319.86	1,523,294.94	5,731,319.86

计入当期损益的政府补助

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
地方政府落户奖励	2,466,166.00		与收益相关
地方政府金融补助	510,000.00		与收益相关
新三板挂牌奖励	15,000.00		与收益相关
地方政府扶持金	399,000.00		与收益相关
合计	3,390,166.00		/

其他说明：

√适用 □不适用

2017 年 1-6 月营业外收入较上年同期增加 4,208,024.92 元，增加比例为 276.24%，主要原因：本期收到政府补助，上期无同类事项发生。

46、营业外支出

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	114,265.29	13,855.96	114,265.29
其中：固定资产处置损失	114,265.29	13,855.96	114,265.29
对外捐赠	902,000.00	2,000.00	902,000.00
滞纳金	943.32	2,556.37	943.32
其他	178.78	20,001.81	178.78
合计	1,017,387.39	38,414.14	1,017,387.39

营业外支出的说明：

2017 年 1-6 月营业外支出较上年同期增加 978,973.25 元，增加比例为 2548.47%，主要原因：本捐赠支出较上年同期增加。

47、所得税费用

(1)、所得税费用表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	34,565,645.50	5,610,509.34
递延所得税费用	-1,335,569.26	5,109,762.89
合计	33,230,076.24	10,720,272.23

(2)、会计利润与所得税费用调整过程：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	-79,375,336.37
按法定/适用税率计算的所得税费用	-19,843,834.09
子公司适用不同税率的影响	-129,365.00
调整以前期间所得税的影响	1,858,801.68
非应税收入的影响	49,225,917.12
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	82,779.40
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	-2,829,196.41
其他	4,864,973.54
所得税费用	33,230,076.24

其他说明：

√适用 □不适用

2017 年 1-6 月所得税费用较上年同期增加 22,509,804.01 元，增加比例为 209.97%，主要原因：本期应纳税所得额增加较上年同期增加。

48、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上期金额
1. 可供出售金融资产产生的利得（损失）金额	-22,634,935.52	-17,450,788.92
减：可供出售金融资产产生的所得税影响	-1,303,950.31	-463,516.05

前期计入其他综合收益当期转入损益的净额	-153,388.43	-3,633,455.42
小计	-21,177,596.78	-13,353,817.45
2.按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额		
减：按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额产生的所得税影响		
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小计		
3.现金流量套期工具产生的利得（或损失）金额		
减：现金流量套期工具产生的所得税影响		
前期计入其他综合收益当期转入损益的净额		
转为被套期项目初始确认金额的调整额		
小计		
4.外币财务报表折算差额		
减：处置境外经营当期转入损益的净额		
小计		
5.其他		6,499,824.30
减：由其他计入其他综合收益产生的所得税影响		
前期其他计入其他综合收益当期转入损益的净额		
小计		6,499,824.30
合计	-21,177,596.78	-6,853,993.15

其他综合收益说明：

2017 年 1-6 月其他综合收益较上年同期减少 14,323,603.63 元，主要原因：本期可供出售金融资产的公允价值减少。

49、现金流量表项目

(1)、收到的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
开放式基金净资金款	26,834,038.97	
收到证券清算款	25,244,843.51	
退回的存出保证金	4,628,722.10	
代扣税费手续费返还	2,244,628.38	1,484,193.07
衍生金融资产净流入	18,721,026.03	44,890,657.75
收回项目款		22,744,760.24
收回冻结资金		34,000,000.00
收到政府补贴	3,390,166.00	
收到融资租赁款	8,735,560.66	
收到保险公司筹建款		4,080,000.00

收到的其它与经营活动有关的现金	6,673,121.54	2,998,734.51
合计	96,472,107.19	110,198,345.57

(2)、支付的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付证券投资者保护基金	15,554,290.02	8,646,245.56
以现金支付的业务及管理费	111,062,547.09	104,793,626.33
资产管理募集资金款		1,426,442.30
暂付定期存款	408,111.11	
支付的其它与经营活动有关的现金	6,128,055.54	4,846,446.53
合计	133,153,003.76	119,712,760.72

(3)、收到的其他与投资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
处置固定资产收回的现金	25,288.16	75,251.29
合计	25,288.16	75,251.29

50、现金流量表补充资料**(1)、现金流量表补充资料**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	-112,605,412.61	143,802,174.67
加：资产减值准备	-11,316,785.62	-16,643,052.11
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	10,813,047.66	8,456,129.50
无形资产摊销	8,712,303.89	6,649,286.93
长期待摊费用摊销	4,148,848.41	3,261,260.76
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）	88,977.13	13,808.27
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）		
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	217,425,530.45	4,763,256.72
财务费用（收益以“-”号填列）	383,195,022.58	308,372,529.34
投资损失（收益以“-”号填列）	-142,620,173.11	-83,132,176.99
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）		
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	-2,628,130.53	5,109,762.89

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少（增加以“－”号填列）	-2,123,097,432.16	-1,432,553,355.39
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-1,320,549,073.75	803,978,846.13
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	4,467,106,604.57	-2,466,142,713.23
其他		34,000,000.00
经营活动产生的现金流量净额	1,378,673,326.91	-2,680,064,242.51
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	5,364,176,607.38	8,547,417,185.02
减：现金的期初余额	8,264,209,120.11	7,472,183,353.68
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	-2,900,032,512.73	1,075,233,831.34

(2)、本期支付的取得子公司的现金净额

适用 不适用

(3)、本期收到的处置子公司的现金净额

适用 不适用

(4)、现金和现金等价物的构成

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	5,364,176,607.38	8,264,209,120.11
其中：库存现金		
可随时用于支付的银行存款	4,053,917,881.02	6,544,595,568.51
可随时用于支付的其他货币资金	480,541.80	16,682,771.08
结算备付金	1,309,778,184.56	1,702,930,780.52
二、现金等价物		
三、期末现金及现金等价物余额	5,364,176,607.38	8,264,209,120.11

51、所有权或使用权受到限制的资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因

货币资金	180,408,111.11	大额存单或定期存款
交易性金融资产	3,054,494,614.50	卖出回购交易质押或停牌
可供出售金融资产	325,402,167.96	以管理人身份认购的集合理财产品份额，承诺存续期内不退出或维持杠杆比例，或已融出
合计	3,560,304,893.57	/

52、外币货币性项目

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	26,444,951.22	6.7744	179,148,677.56
港币	360,241.09	0.8679	312,660.5
结算备付金			
美元	1,187,069.39	6.7744	8,041,682.84
港币	6,022,798.36	0.8679	5,227,307.15
存出保证金			
美元	270,000.00	6.7744	1,829,088.00
港币	500,000.00	0.8679	433,960.00
其他应收款			
美元	1,259,000.00	6.7744	8,528,969.60
代理买卖证券款			
美元	1,079,970.11	6.7744	7,316,149.51
港币	5,092,982.05	0.8679	4,420,300.97

八、母公司财务报表主要项目附注

1、长期股权投资

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
对联营企业投资	28,272,604.81	28,246,606.00
对子公司投资	1,800,000,000.00	1,500,000,000.00
合计	1,828,272,604.81	1,528,246,606.00

本期公司对全资子公司太证非凡投资有限公司增资 300,000,000.00 元。

(1) 长期股权投资明细情况

单位：元 币种：人民币

被投资单位	投资成本	期初余额	增减变动	期末余额	在被投资单位持股比例	在被投资单位表决权比例
权益法：						
老-中证券	30,658,208.15	28,246,606.00	25,998.81	28,272,604.81	39%	39%
成本法：						

太证资本	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00		1,000,000,000.00	100%	100%
太证非凡	800,000,000.00	500,000,000.00	300,000,000.00	800,000,000.00	100%	100%

(2) 联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

2、手续费及佣金净收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入	320,790,469.94	390,930,285.68
其中：证券经纪业务收入	175,540,686.56	250,719,631.69
——代理买卖证券业务收入	169,043,479.06	238,039,750.72
——经纪业务席位收入	6,268,567.85	10,401,130.01
——代销金融产品业务收入	228,639.65	2,278,750.96
投资银行业务收入	44,438,063.64	85,360,519.68
——证券承销业务收入	10,901,886.80	34,969,999.99
——财务顾问业务收入	30,517,308.92	49,447,123.46
——证券保荐业务收入	3,018,867.92	943,396.23
资产管理业务收入	95,804,528.20	49,759,581.07
投资咨询业务收入	108,354.71	319,741.50
其他业务收入	4,898,836.83	4,770,811.74
手续费及佣金支出	49,109,084.90	56,739,789.55
其中：证券经纪业务支出	39,702,057.96	50,738,333.56
——代理买卖证券业务支出	39,702,057.96	50,738,333.56
投资银行业务支出	2,752,174.63	1,188,679.25
——证券承销业务支出	2,752,174.63	1,188,679.25
资产管理业务支出	6,193,792.06	4,212,866.48
其他业务支出	461,060.25	599,910.26
手续费及佣金净收入	271,681,385.04	334,190,496.13

手续费及佣金净收入的说明：

2017年1-6月手续费及佣金净收入较上年同期减少62,509,111.09元，减少比例为18.70%，主要原因：本期交易量减少，相应经纪业务收入较上年同期减少。

3、利息净收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	732,990,768.13	591,265,825.39
其中：存放金融同业利息收入	160,546,417.47	86,538,454.00
——自有资金存款利息收入	122,947,596.71	42,788,241.44

——客户资金存款利息收入	37,598,820.76	43,750,212.56
买入返售金融资产利息收入	483,793,947.22	401,253,869.67
——其中约定购回利息收入	632,741.10	87,535.57
——股权质押回购利息收入	316,004,698.84	363,082,222.94
——其他买入返售利息收入	167,156,507.28	38,084,111.16
融资融券业务利息收入	83,042,404.21	95,068,892.93
——融资利息收入	82,814,090.87	92,943,590.15
——融券利息收入	228,313.34	2,125,302.78
其他	5,607,999.23	8,404,608.79
利息支出	560,165,683.86	388,026,794.00
其中：客户存款利息支出	8,096,722.52	9,500,306.69
债券回购利息支出	170,280,375.31	65,864,797.86
短期借款利息支出	82,579,575.03	70,208,431.12
拆入资金利息支出	396,300.01	3,110,358.32
应付债券利息支出	74,356,546.59	39,238,790.41
次级债券利息支出	224,456,164.40	200,104,109.60
利息净收入	172,825,084.27	203,239,031.39

利息净收入的说明：

2017 年 1-6 月利息净收入较上年同期减少 30,413,947.12 元，减少比例为 14.96%，主要原因：本期债券回购利息支出较上年同期增加。

4、投资收益

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益		
权益法核算的长期股权投资收益	25,998.81	-41,809.76
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	126,149,769.98	38,690,880.76
其中：持有期间取得的收益	141,063,748.21	284,435,866.05
——交易性金融资产	112,227,349.05	208,989,420.41
——持有至到期投资	1,341,175.21	1,742,840.94
——可供出售金融资产	27,495,223.95	73,703,604.70
——衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	-14,913,978.23	-245,744,985.29
——交易性金融资产	-100,899,992.91	-252,371,920.55
——持有至到期投资		4,798,130.26
——可供出售金融资产	86,328,258.30	1,732,806.89
——衍生金融工具	-342,243.62	95,998.11

合计	126,175,768.79	38,649,071.00
----	----------------	---------------

投资收益的说明:

2017 年 1-6 月投资收益较上年同期增加 87,526,697.79 元, 增加比例为 226.47%, 主要原因: 本期交易性金融资产投资收益较上年同期增加。

(1) 按权益法核算的长期股权投资收益

单位: 元 币种: 人民币

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
老-中证券有限公司	25,998.81	-41,809.76	被投资企业本期盈利
合计	25,998.81	-41,809.76	

(2) 投资收益汇回无重大限制。

5、公允价值变动收益

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-224,505,944.30	22,325,646.23
交易性金融负债		
衍生金融工具	-4,060.00	-7,260.00
合计	-224,510,004.30	22,318,386.23

公允价值变动收益的说明:

2017 年 1-6 月公允价值变动收益较上年同期减少 246,828,390.53 元, 主要原因: 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公允价值变动所致。

6、业务及管理费

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
工资	241,804,048.14	220,137,003.39
职工养老保险金	30,645,629.30	23,174,239.70
住房公积金	13,982,618.15	10,007,301.80
租赁费	13,229,150.59	10,430,518.22
差旅费	12,889,844.74	9,883,651.88
业务招待费	12,810,713.66	13,624,046.77
邮电通讯费	12,601,460.09	6,321,734.89
折旧费	10,773,774.92	8,416,319.20
职工医疗保险金	10,474,793.02	7,328,913.65
电子设备运转费	10,423,222.22	10,914,504.75

其他	58,673,832.21	73,445,546.03
合计	428,309,087.04	393,683,780.28

九、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

2、同一控制下企业合并

适用 不适用

3、反向购买

适用 不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

公司全资子公司太证资本的控股子公司湖北太证投资管理有限公司于 2017 年 2 月 20 日签署股权转让协议，将其持有的武汉光谷人才投资管理有限公司 35% 股权转让给太证资本，并处置了剩余 16% 股权，丧失了对武汉光谷人才投资管理有限公司的控制权。丧失控制权之日剩余股权的账面价值为 1,750,000.00 元，剩余股权的净资产份额为 1,045,721.07 元。

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

适用 不适用

一揽子交易

适用 不适用

非一揽子交易

适用 不适用

5、其他原因的合并范围变动

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：

适用 不适用

(1) 本期合并范围发生变更的说明

本报告期子公司湖北太证投资管理有限公司丧失了对武汉光谷人才投资管理有限公司的控制权。因此，武汉光谷人才投资管理有限公司作为管理人管理的 2 家合伙企业（武汉光谷人才创新投资合伙企业和武汉光谷人才创业投资合伙企业），不再纳入本期合并财务报表范围。

公司将本公司为管理人，且以自有资金参与、并满足 2014 年新修订企业会计准则规定“控制”定义的结构化主体集合资产管理计划纳入合并报表范围，本期减少 6 家集合资产管理计划，因其依据协议到期正常终止。详见附注十、在其他主体中的权益。

(2) 本期末无特殊目的主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体。

6、其他

适用 不适用

十、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

企业集团的构成

适用 不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
太证资本管理有限责任公司	北京	北京	股权投资管理	100		出资设立
太证非凡投资有限公司	上海	上海	投资管理	100		出资设立
上海太证投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		100	出资设立
西藏太证投资有限公司	西藏	西藏	投资管理		100	出资设立
西藏正奇投资有限公司	西藏	西藏	投资管理		100	出资设立
湖北太证投资管理有限公司	武汉	武汉	投资管理		51	出资设立
太证国际控股有限公司 BVI	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	投资管理		100	出资设立
正奇国际控股有限公司 BVI	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	投资管理		100	出资设立
静远国际控股有限公司 BVI	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	投资管理		100	出资设立
广东广垦太证股权投资基金管理有限公司	深圳	深圳	基金管理		51	出资设立
太证融资租赁有限公司	上海	上海	融资租赁		65	购买
宁波甬隆股权投资有限公司	宁波	宁波	投资管理		51	出资设立
嘉兴太证锦苑投资管理有限公司	嘉兴	嘉兴	投资管理		51	出资设立
广西中垦太证基金管理有限公司	南宁	南宁	基金管理		60	出资设立

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

截至 2017 年 6 月 30 日，公司及子公司作为合伙企业的普通合伙人拥有广东广垦太证现代农业股权投资基金（有限合伙）、太证中投创新（武汉）股权投资基金企业（有限合伙）、北京广垦太证医药投资中心（有限合伙）、北京太证正能股权投资中心（有限合伙）、北京

太证恒通股权投资中心（有限合伙）、北京广垦太证投资中心（有限合伙）、北京太证未名股权投资中心（有限合伙）、上海太证洛融投资合伙企业（有限合伙）8 家有限合伙企业完全、独占及排他的管理决策权力，且其他投资方也无权撤销此管理决策权，公司能够对其实施控制，因此将此 8 家合伙企业纳入合并范围。

按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》的规定，公司将公司为管理人且以自有资金参与、所承担的收益（或损失）与产品收益相关的可变回报重大、并满足 2014 年新修订企业会计准则规定“控制”定义的结构化主体太平洋红珊瑚稳盈债券分级集合资产管理计划、太平洋证券红珊瑚智汇 1 号分级集合资产管理计划、太平洋浦银 1 号分级集合资产管理计划、太平洋证券红珊瑚智汇 12 号分级集合资产管理计划，共 4 只集合资产管理计划产品纳入合并报表范围。

截至 2017 年 6 月 30 日，合并集合资产管理计划的总资产为人民币 1,386,485,121.61 元。公司在上述集合资产管理计划中的权益体现在资产负债表中可供出售金融资产，金额为人民币 269,014,004.79 元。

2、在合营企业或联营企业中的权益

适用 不适用

不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/本期发生额	期初余额/上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	70,245,159.14	68,246,606.00
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	248,553.14	-41,809.76
--其他综合收益		
--综合收益总额	248,553.14	-41,809.76

3、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

适用 不适用

公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括公司发起设立的资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。公司所承担的与产品收益相关的可变回报并不重大，因此未合并此类产品。

截至 2017 年 6 月 30 日, 公司通过直接持有公司发起设立的结构化主体中享有的权益在公司资产负债表中的可供出售金融资产项目账面价值为 1,040,471,794.62 元, 最大损失风险敞口为 1,040,471,794.62 元。

十一、与金融工具相关的风险

√适用 □不适用

与金融工具相关的风险情况详见附注十七、风险管理。

十二、公允价值的披露

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
一、持续的公允价值计量				
(一)以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	4,805,190,502.97	4,675,258,146.16		9,480,448,649.13
1. 交易性金融资产	4,805,190,502.97	4,675,258,146.16		9,480,448,649.13
(1) 债务工具投资		4,675,258,146.16		4,675,258,146.16
(2) 权益工具投资	4,805,190,502.97			4,805,190,502.97
(3) 衍生金融资产				
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(二) 可供出售金融资产	1,324,924,451.04	1,758,827,435.85		3,083,751,886.89
(1) 债务工具投资	948,120,490.00	30,000,000.00		978,120,490.00
(2) 权益工具投资	376,803,961.04	1,728,827,435.85		2,105,631,396.89
(3) 其他				
(三) 衍生金融资产	235,361,670.88			235,361,670.88
持续以公允价值计量的资产总额	6,365,476,624.89	6,434,085,582.01		12,799,562,206.90
(五) 交易性金融负债	102,563,318.83			102,563,318.83
其中：发行的交易性债券				
衍生金融负债	102,563,318.83			102,563,318.83
其他				
(六) 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		970,724,087.74		970,724,087.74
持续以公允价值计量的负债总额	102,563,318.83	970,724,087.74		1,073,287,406.57
二、非持续的公允价值计量				
非持续以公允价值计量的资产总额				

非持续以公允价值计量的负债总额				
-----------------	--	--	--	--

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

适用 不适用

对于存在活跃市场的以公允价值计量且其变动计入当期损益的资产及负债、可供出售金融资产，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。

活跃市场，是指相关资产或负债的交易量和交易频率足以持续提供定价信息的市场。

3、持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

适用 不适用

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。国债期货合约、股指期货合约及利率互换合约的公允价值是根据市场报价来确定的。

4、持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

适用 不适用

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

适用 不适用

6、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

适用 不适用

7、本期内发生的估值技术变更及变更原因

适用 不适用

8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况√适用 不适用

本公司持有的不具有控制、共同控制及重大影响的少数非上市股权共计 614,251,539.78 元，由于公允价值无法可靠计量而采用按成本计量。

9、其他 适用 不适用**十三、关联方及关联交易****1、本企业的母公司情况**√适用 不适用

截至 2017 年 6 月 30 日，本公司无母公司或最终控制方。

2、本企业的子公司情况√适用 不适用

本企业子公司的情况详见附注十、1 在子公司中的权益

3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

√适用 不适用

本企业合营或联营企业详见附注十、2 在合营和联营企业中的权益

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

 适用 不适用**4、其他关联方情况**√适用 不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
大华大陆投资有限公司	关联人（与公司同一董事长）
北京华信六合投资有限公司	参股股东
北京玺萌财富投资管理有限公司	其他
玺萌融投资控股有限公司	其他
云南惠众股权投资基金管理有限公司	其他
云南惠君投资合伙企业（有限合伙）	其他
太平洋特别并购公司	其他

其他说明

√适用 □不适用

北京玺萌财富投资管理有限公司总经理、玺萌融投资控股有限公司总经理丁吉先生系本公司董事；云南惠众股权投资基金管理有限公司董事长兼总经理、云南惠君投资合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表黄静波先生系本公司监事；公司对太平洋特别并购公司派有两名董事。

5、关联交易情况

(1)、关键管理人员报酬

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	2,761.66	2,785.20

(2)、其他关联交易

√适用 □不适用

公司拟与关联方北京华信六合投资有限公司、大华大陆投资有限公司以及其他方共同发起设立基金管理有限公司。该基金管理公司注册资本为人民币 1 亿元，其中公司出资 3,456 万元，占注册资本 34.56%。本次共同投资构成关联交易。

2017 年 4 月 21 日，公司第四届董事会第八次会议审议通过了《关于放弃控股子公司股权转让优先认购权暨关联交易的议案》，公司间接控股子公司瑞辰绿能（上海）融资租赁有限公司的参股股东拟将所持 10%股权转让给公司关联法人北京华信六合投资有限公司，导致公司与关联法人构成共同投资关联交易。公司放弃本次股权转让优先认购权。2017 年 6 月 12 日，本次股权转让已经完成，瑞辰绿能（上海）融资租赁有限公司的名称同时变更为太证融资租赁有限公司。

本报告期内，公司从关联方北京玺萌财富投资管理有限公司取得资产托管收入 4.81 万元。公司从关联方大华大陆投资有限公司、北京玺萌财富投资管理有限公司、玺萌融投资控股有限公司及公司相关关联自然人取得经纪业务净佣金收入 4.00 万元。云南惠众股权投资基金管理有限公司及公司相关关联自然人认购公司发行的资管产品，公司因此取得资产管理业务收入 1,539.47 万元。

6、关联方应收应付款项

(1)、应收项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
其他应收款	太平洋特别并购公司	6,496,649.60	32,483.25	3,468,500.00	17,342.50

公司为关联方暂时垫支的费用。

(2)、应付项目

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	大华大陆投资有限公司	6,090,000.00	6,090,000.00
其他应付款	北京华信六合投资有限公司	9,042,000.00	2,750,000.00

关联方为设立基金管理公司存入的筹备费用。

7、关联方承诺

适用 不适用

2014 年 4 月，公司完成非公开发行股票事宜，发行股票 7 亿股。本次发行新增股份于 2014 年 4 月 21 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了登记托管手续。其中，持股 5% 以上的股东北京华信六合投资有限公司认购的 15,000 万股份自本次发行股份上市之日起 60 个月内不得转让。2014 年 10 月，公司完成 2014 年半年度资本公积金转增股本事宜，每 10 股转增 5 股，转增后承诺限售的股份增至 22,500 万股。2016 年 9 月，公司完成 2016 年半年度资本公积金转增股本事宜，每 10 股转增 5 股，转增后承诺限售的股份增至 33,750 万股。

8、其他

适用 不适用

十四、股份支付

1、股份支付总体情况

适用 不适用

2、以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

3、以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

4、股份支付的修改、终止情况

□适用 √不适用

5、其他

□适用 √不适用

十五、承诺及或有事项**1、重要承诺事项**

√适用 □不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

经营租赁承诺事项：

根据公司因租赁办公场所而签订的不可撤销的经营性租赁合同，未来最低应支付租金汇总如下：

单位：元 币种：人民币

剩余租赁期	最低租赁付款额
1 年以内（含 1 年）	24,257,439.91
1 年以上 2 年以内（含 2 年）	18,648,431.19
2 年以上 3 年以内（含 3 年）	10,024,591.58
3 年以上	2,419,817.92
合计	55,350,280.60

2、或有事项**(1)、资产负债表日存在的重要或有事项**

√适用 □不适用

A.公司于 2016 年 7 月 4 日向中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会递交了与浙江海宁巨铭投资合伙企业（有限合伙）因签订的《股票质押式回购交易客户协议》履行引起的纠纷的仲裁申请。2016 年 11 月 1 日，中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会出具（2016）中国贸仲京（深）裁字第 0081 号裁决书，裁决浙江海宁巨铭投资合伙企业（有限合伙）向公司支付融资款 15,000 万元及利息、违约金、相关费用。公司有权对其质押的股票折价或以拍卖、变卖该股票的价款优先受偿。2016 年 12 月 5 日，公司向浙江省嘉兴市中级人民法院申请强制执行。嘉兴市中级人民法院根据相关规定，向山东省高级人民法院申请移送执行。截至报告期末，本仲裁案件执行程序尚未终结。

B.公司于 2016 年 7 月 14 日向上海市第一中级人民法院提出了与上海东方国贸投资管理有限公司、自然人孙寿祥、上海东方国贸有限公司之间因金融借款合同引起债权债务纠纷的诉讼申请。2017 年 1 月 13 日，上海市第一中级人民法院出具（2016）沪 01 民初 554 号《民事判决书》，判决上海东方国贸投资管理有限公司向公司偿还全部债务 14,443.77 万元及利

息、相关费用，孙寿祥、上海东方国贸有限公司对判决书的前三项判决承担连带清偿责任。公司有权对其抵押房屋产权折价，或者以拍卖、变卖该抵押物所得的价款优先受偿。公司于判决生效后立即向法院申请强制执行，2017年6月27日上海市第一中级人民法院出具(2017)沪01执181号《执行裁定书》，因被执行人名下财产已被有关法院另案查封，暂无财产可供执行，终结本案执行程序，之后发现有可供执行财产的，可再次申请执行。截至报告期末，公司对上海东方国贸投资管理有限公司 8,237.37 万元应收款项，已计提金额为 1,647.47 万元的坏账准备，未形成预计负债。

C.根据公司 2015 年第二次临时股东大会审议通过的《关于公司实施境内外债务融资及授权的议案》的相关授权，公司全资子公司太证资本下属的上海太证与银行签订《担保协议》，银行同意为其境外全资子公司正奇国际向境外分行申请的累计 2,400 万美元融资开立保函/备用信用证，在限额内承担保证责任；同时，上海太证将人民币 18,000 万元定期存款单出质给银行。截至报告期末，公司及全资子公司累计提供对外担保总额 2,400 万美元，占公司 2016 年 12 月 31 日经审计净资产的 1.41%。公司不存在其他对外担保事项及逾期担保事项。

(2)、公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

3、其他

适用 不适用

十六、资产负债表日后事项

1、重要的非调整事项

适用 不适用

2、利润分配情况

适用 不适用

3、销售退回

适用 不适用

4、其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

十七、风险管理

1、风险管理政策及组织架构

(1)、风险管理政策

适用 不适用

公司风险管理的总体目标是，确保公司在风险可承受的范围内运营，促进公司发展战略的实现。

公司遵循全面性、审慎性和适应性等原则进行风险管理。其中，全面性原则要求：公司建立健全全面风险管理体系，并为此建立可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制；公司董事会、经理层以及全体员工共同参与风险管理，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险等包括洗钱风险在内的各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理；公司将所有子公司纳入全面风险管理体系，强化分支机构风险管理，实现风险管理全覆盖。审慎性原则要求：在全公司推行稳健的风险文化；建立风险管理理念、价值准则、职业操守的培训、传达和监督机制；明确董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司履行全面风险管理的职责分工，建立多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。适应性原则要求：全面风险管理体系与公司发展战略相适应；形成与公司相适应的风险管理理念、价值准则、职业操守；定期评估全面风险管理体系，并根据结果及时改进风险管理工作。

(2)、风险治理组织架构

适用 不适用

公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，建立健全全面风险管理体系。董事会、经理层以及全体员工共同参与风险管理，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险等包括洗钱风险在内的各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。

董事会承担全面风险管理的最终责任，履行如下风险管理职责：推进风险文化建设；审议批准公司全面风险管理的基本制度；审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；审议公司定期风险评估报告；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；建立与首席风险官的直接沟通机制等。董事会授权其下设的风险管理委员会履行其部分风险管理职责。

监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经理层对全面风险管理承担主要责任，履行如下风险管理职责：制定风险管理制度，并适时调整；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；

制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实，对其进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司设首席风险官负责全面风险管理工作，并按照有关法律法规和自律规则的要求，为首席风险官履职提供充分保障。首席风险官为公司高级管理人员，履行如下职责：督导公司风险管理制度建设；组织实施公司风险管理制度；检查评估公司风险管理制度执行情况；向董事会和经理层报告或者传递风险信息。

风险管理部在首席风险官的领导下，履行如下职责：推动全面风险管理工作；监测、评估、报告公司整体风险水平；为业务决策提供风险管理建议；协助、指导和检查各部门、分支机构和子公司的风险管理工作；向首席风险官报告风险信息。

经理层分别指定了履行流动性风险管理和声誉风险管理职责的具体部门。

各业务部门、分支机构和子公司负责人承担风险管理的直接责任，履行如下风险管理职责：为所负责部门、分支机构或者子公司配备必要的风险管理人员；全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险；及时识别、评估、应对和报告相关风险；贯彻落实公司和内部风险管理制度等。

公司将子公司的风险管理纳入统一体系，对其风险管理工作实行垂直管理。

2、信用风险

适用 不适用

信用风险是指因借款人或者交易对手未能履行有关契约中约定的义务而使公司遭受经济损失的可能性。公司主要因持有债券类投资和从事证券融资类业务而面临信用风险。

3、流动风险

适用 不适用

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。公司坚持资金的统一管理和运作，持续加强资金管理体系的建设，由资金运营部统一进行公司资金管理工作。公司通过建立业务资金计划管理机制，对业务资金和规模进行分析、逐日流动性监管指标计算和债务到期分布分析等方式，确定公司在不同时期所需的资金规模和期限结构，通过长短期搭配的融资方式进行资金储备。重视并保持与各个银行和同业机构之间的合作关系，积极扩充融资渠道，使公司的整体流动性保持在较为安全的状态。

4、市场风险

√适用 □不适用

市场风险是指所持有的金融工具的公允价值因市场价格波动而波动，并使公司遭受非预期经济损失的可能性。市场风险可以按照市场价格的类型，划分为股价风险、利率风险、汇率风险和商品价格风险。公司面临的市场风险主要是股价风险和利率风险。公司因持有股票等权益类证券及其衍生品而面临股价风险。公司因持有债券类投资等非权益类证券及其衍生品而面临利率风险。

十八、其他重要事项

1、年金计划

√适用 □不适用

公司依据国家企业年金制度的相关政策建立了《太平洋证券股份有限公司企业年金方案》。公司按照上一年度职工工资总额的一定比例计提企业年金，并为符合年金方案条件的职工缴纳企业年金。

根据昆明市人力资源和社会保障局《关于太平洋证券股份有限公司企业年金方案备案的复函》（昆人社函[2014]94号），公司企业年金计划于2014年1月1日正式建立。该年金计划的受托管理人为招商银行股份有限公司，账户管理人及托管人为中国工商银行股份有限公司，投资管理人为泰康资产管理有限公司。

根据云南省人力资源和社会保障厅《关于确认太平洋证券股份有限公司企业年金计划的函》（云人社函[2014]392号），公司企业年金计划登记号为530000140001。根据公司与受托管理人签订的《太平洋证券股份有限公司企业年金计划受托管理合同》，以及受托管理人与账户管理人、托管人、投资管理人分别签订的《太平洋证券股份有限公司企业年金计划账户管理合同》、《太平洋证券股份有限公司企业年金计划托管合同》、《太平洋证券股份有限公司企业年金计划投资管理合同》规定，各方管理人于合同存续期间内，负责企业年金基金的管理运作。

2、分部信息

(1)、报告分部的确定依据与会计政策

√适用 □不适用

公司以内部组织结构、管理要求、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。分部会计政策与合并财务报表会计政策一致。公司主要分部为证券经纪业务、证券投资业务、投资银行业务、资产管理业务和其他业务。

(2)、报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	证券经纪业务	证券投资业务	投资银行业务	资产管理业务	其他业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	286,235,652.25	-202,825,574.28	43,945,181.96	113,389,206.46	190,165,431.09	57,365,774.51	373,544,122.97
手续费及佣金净收入	136,149,908.29	-456,345.25	43,945,181.96	82,262,620.64	7,945,614.88	766,970.14	269,080,010.38
其他收入	150,085,743.96	-202,369,229.03		31,126,585.82	182,219,816.21	56,598,804.37	104,464,112.59
二、营业支出	169,859,432.21	1,350,359.27	69,082,814.39	54,694,478.63	163,684,777.45	1,038,470.14	457,633,391.81
三、营业利润	116,376,220.04	-204,175,933.55	-25,137,632.43	58,694,727.83	26,480,653.64	56,327,304.37	-84,089,268.84
四、资产总额	4,705,172,275.92	10,051,806,829.11	15,078,120.18	216,470,535.52	27,064,812,034.72	2,563,186,836.62	39,490,152,958.83
五、负债总额	3,992,769,455.98	10,263,586,257.47	45,019,803.66	124,629,542.09	12,366,271,009.81	-830,553,781.85	27,622,829,850.86
六、补充信息							
1、折旧和摊销费用	8,314,747.00	405,538.85	331,537.48	2,075,298.32	12,547,078.31		23,674,199.96
2、资本性支出	8,053,118.09	644,976.23	163,270.79	1,922,650.83	17,256,017.29		28,040,033.23
3、资产减值损失	-9,685,659.15				-1,631,126.47		-11,316,785.62

3、以公允价值计量的资产和负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
金融资产					
1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产）	7,563,931,191.26	-217,421,470.45			9,480,448,649.13
2、衍生金融资产	243,444,369.60	-4,060.00			235,361,670.88
3、可供出售金融资产	4,249,650,914.57		-101,548,239.80		3,083,751,886.89
金融资产小计	12,057,026,475.43	-217,425,530.45	-101,548,239.80		12,799,562,206.90
金融负债					
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	1,113,470,014.66				970,724,087.74
衍生金融负债	91,924,991.52				102,563,318.83
金融负债小计	1,205,395,006.18				1,073,287,406.57

4、其他

√适用 □不适用

2016年6月13日，公司召开2016年第二次临时股东大会审议通过了公开发行A股可转换公司债券的相关议案。公司拟公开发行可转换为公司A股股票的公司债券，发行规模不超过人民币37亿元（含）。2017年2月27日，公司召开第四届董事会第五次会议审议通过了《关于调减A股可转换公司债券发行规模及相应调整发行方案有关条款的议案》等相关议案，对公开发行A股可转换公司债券方案进行调整，将发行规模调减为“不超过人

民币 17 亿元（含）”，原方案中其他条款不作改变。2017 年 6 月 23 日，公司召开 2017 年第一次临时股东大会审议通过了《关于延长公司公开发行 A 股可转换公司债券股东大会决议有效期的议案》、《关于延长授权董事会全权办理本次公开发行 A 股可转换公司债券有关事宜有效期的议案》，将本次公开发行 A 股可转换公司债券相关决议和授权有效期自前次有效期到期之日起延长 12 个月，至 2018 年 6 月 13 日。该事项尚需得到中国证券监督管理委员会核准。有关本次公开发行可转债的具体情况详见公司发布的相关临时公告，公司将根据可转债相关事项进展情况，及时发布公告。

十九、补充资料

1、当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-88,977.13	固定资产清理损失
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	3,390,166.00	落户奖励等
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	1,412,743.60	收到代扣手续费返还等收入
所得税影响额	-1,178,718.95	
少数股东权益影响额	-48,097.72	
合计	3,487,115.80	

2、净资产收益率及每股收益

√适用 □不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	-1.05	-0.018	-0.018
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	-1.08	-0.019	-0.019

(1) 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：P₀ 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；E₀ 为归属于公司普通股股东的期初净资产；E_i 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_j 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；M₀ 为报告期月份数；M_i 为新增净资产次月起至报告期期末的累计月数；M_j 为减少净资产次月起至报告期期末的累计月数；E_k 为因其他交易或事项引起的净资产增减变动；M_k 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。

2017 年 1-6 月加权平均净资产收益率为：

$$-1.05\% = -123,199,035.32 \div (11,817,176,734.39 - 123,199,035.32 \div -2-204,489,491.10 \times 2 \div 6) \times 100\%$$

扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率为：

$$-1.08\% = -126,686,151.12 \div (11,817,176,734.39 - 123,199,035.32 \div -2-204,489,491.10 \times 2 \div 6) \times 100\%$$

(2) 基本每股收益 = $P0 \div S$

$$S = S0 + S1 + Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk$$

其中：P0 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 为报告期月份数；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。

2017 年 1-6 月基本每股收益为：

$$-0.018 \text{ 元} = -123,199,035.32 \div 6,816,316,370.00$$

扣除非经常性损益后的基本每股收益为：

$$-0.019 \text{ 元} = -126,686,151.12 \div 6,816,316,370.00$$

(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，应考虑所有稀释性潜在普通股对 P1 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。

截至 2017 年 6 月末，公司未发行可转换债券、股份期权、认股权证等稀释性潜在普通股，因此，稀释每股收益等于基本每股收益。

第十一节 备查文件目录

备查文件目录	一、载有法定代表人、主管会计工作负责人和会计机构负责人签名并盖章的会计报表；
	二、报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露过的所有公司文件的正本及公告原稿。

董事长：郑亚南

太平洋证券股份有限公司

董事会批准报送日期：2017 年 8 月 24 日

修订信息

适用 不适用

第十二节 证券公司信息披露

一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

1、根据深交所《关于同意太平洋证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函》（深证函（2017）120号），同意公司开展上市公司股权激励行权融资业务试点。

2、根据云南证监局《关于核准太平洋证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（云证监许可（2017）2号），核准公司变更《太平洋证券股份有限公司章程》的重要条款。

3、根据云南证监局《云南证监局关于核准康静证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》（云证监许可（2017）1号），核准康静证券公司经理层高级管理人员任职资格。

二、监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

公司 2016 年被评为 B 类 BBB 级；2017 年被评为 A 类 A 级。