

国信证券股份有限公司 2017 年第一季度报告正文

第一节 重要提示

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

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人何如、主管会计工作负责人岳克胜及会计机构负责人周中国声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标（合并报表）

单位：人民币元

| 项目 | 本报告期末 (2017 年 3 月 31 日) | 上年度末 (2016 年 12 月 31 日) | 本报告期末比上年度末 增减 |
|---------------|----------------------------|----------------------------|------------------|
| 总资产 | 185,092,638,864.94 | 193,029,464,345.17 | -4.11% |
| 归属于上市公司股东的净资产 | 49,656,920,547.13 | 48,390,683,380.53 | 2.62% |

单位：人民币元

| 项目 | 本报告期 (2017 年 1-3 月) | 上年同期 (2016 年 1-3 月) | 本报告期比上年同期 增减 |
|------------------------|------------------------|------------------------|-----------------|
| 营业收入 | 2,602,497,399.83 | 2,880,358,328.68 | -9.65% |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 1,040,965,772.96 | 842,783,492.99 | 23.52% |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 1,022,061,796.61 | 841,731,908.89 | 21.42% |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -2,398,762,076.77 | -4,896,609,564.51 | 51.01% |
| 基本每股收益（元/股） | 0.13 | 0.10 | 30.00% |
| 稀释每股收益（元/股） | 0.13 | 0.10 | 30.00% |
| 加权平均净资产收益率 | 2.12% | 1.69% | 上升 0.43 个百分点 |

单位：人民币元

| 非经常性损益项目 | 年初至报告期期末金额 (2017 年 1-3 月) | 说明 |
|---|------------------------------|--------------|
| 非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分） | -508,894.17 | |
| 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） | 26,164,765.10 | 主要是收到各项政府补助。 |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益 | -1,266,299.95 | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | 706,634.46 | |
| 减：所得税影响额 | 6,192,229.09 | |
| 合计 | 18,903,976.35 | |

证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融工具和可供出售金融资产取得的投资收益不作为非经常性损益项目。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

(一) 普通股股东总数和表决权恢复的优先股股东数量及前 10 名股东持股情况表

单位：股

| 报告期末普通股股东总数 | 124,222 户 | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数 | 不适用 | | |
|---------------------------------|-------------|-------------------|---------------|---------------|---------|
| 前 10 名股东持股情况 | | | | | |
| 股东名称 | 股东性质 | 持股比例 | 持股数量 | 持有有限售条件的股份数量 | 质押或冻结情况 |
| 深圳市投资控股有限公司 | 国有法人 | 33.53% | 2,749,526,814 | 2,749,526,814 | 无 |
| 华润深国投信托有限公司 | 国有法人 | 25.15% | 2,062,145,110 | 1,652,145,110 | 无 |
| 云南红塔集团有限公司（注） | 国有法人 | 16.77% | 1,374,763,407 | 1,237,287,067 | 无 |
| 中国第一汽车集团公司 | 国有法人 | 4.28% | 350,564,669 | 315,508,203 | 无 |
| 北京城建投资发展股份有限公司 | 境内非国有法人 | 4.18% | 343,000,000 | - | 无 |
| 全国社会保障基金理事会 | 国有法人 | 0.62% | 50,473,186 | 50,473,186 | 无 |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 国有法人 | 0.60% | 49,477,100 | - | 无 |
| 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 | 其他 | 0.56% | 45,555,080 | - | 无 |
| 前海人寿保险股份有限公司－海利年年 | 其他 | 0.41% | 33,704,946 | - | 无 |
| 工银瑞信基金－农业银行－工银瑞信中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 南方基金－农业银行－南方中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 中欧基金－农业银行－中欧中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 博时基金－农业银行－博时中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 大成基金－农业银行－大成中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 嘉实基金－农业银行－嘉实中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 广发基金－农业银行－广发中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 华夏基金－农业银行－华夏中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 银华基金－农业银行－银华中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 易方达基金－农业银行－易方达中证金融资产管理计划 | 其他 | 0.34% | 27,792,800 | - | 无 |
| 前 10 名无限售条件股东持股情况 | | | | | |
| 股东名称 | 持有无限售条件股份数量 | 股份种类 | | | |
| | | 股份种类 | 数量 | | |
| 华润深国投信托有限公司 | 410,000,000 | 人民币普通股 | 410,000,000 | | |
| 北京城建投资发展股份有限公司 | 343,000,000 | 人民币普通股 | 343,000,000 | | |
| 云南红塔集团有限公司（注） | 137,476,340 | 人民币普通股 | 137,476,340 | | |

| | | | |
|-------------------------------------|--|--------|------------|
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 49,477,100 | 人民币普通股 | 49,477,100 |
| 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 | 45,555,080 | 人民币普通股 | 45,555,080 |
| 中国第一汽车集团公司 | 35,056,466 | 人民币普通股 | 35,056,466 |
| 前海人寿保险股份有限公司－海利年年 | 33,704,946 | 人民币普通股 | 33,704,946 |
| 工银瑞信基金－农业银行－工银瑞信中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 南方基金－农业银行－南方中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 中欧基金－农业银行－中欧中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 博时基金－农业银行－博时中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 大成基金－农业银行－大成中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 嘉实基金－农业银行－嘉实中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 广发基金－农业银行－广发中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 华夏基金－农业银行－华夏中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 银华基金－农业银行－银华中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 易方达基金－农业银行－易方达中证金融资产管理计划 | 27,792,800 | 人民币普通股 | 27,792,800 |
| 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 | 18,948,524 | 人民币普通股 | 18,948,524 |
| 华信信托股份有限公司 | 12,070,090 | 人民币普通股 | 12,070,090 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 深圳市人民政府国有资产监督管理委员会（以下简称“深圳市国资委”）持有公司控股股东深圳市投资控股有限公司（以下简称“深投控”）100%股权，同时深圳市国资委还持有公司第二大股东华润深国投信托有限公司（以下简称“华润信托”）49%的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。 | | |
| 前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明 | 无。 | | |

注：截至本报告披露日，公司股东云南红塔集团有限公司（以下简称“云南红塔”）已注销，云南合和（集团）股份有限公司（以下简称“云南合和”）承继云南红塔持有的公司股份事项正在中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）审核中。具体请见第三节“二、重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明”。

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

（二）公司优先股股东总数及前 10 名优先股股东持股情况

公司未发行优先股。

第三节 重要事项

一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因（合并报表）

单位：人民币元

| 项目 | 2017年3月31日 | 2016年12月31日 | 增减幅度 | 主要变动原因 |
|------------------------|-------------------|-------------------|----------|--|
| 衍生金融资产 | 1,837,550.84 | - | 不适用 | 主要是收益互换公允价值变动。 |
| 应收款项 | 3,516,722,668.17 | 1,380,633,849.20 | 154.72% | 主要是应收投资款增加。 |
| 应付短期融资款 | 5,860,388,000.00 | 611,391,000.00 | 858.53% | 主要是发行证券公司短期公司债券及短期收益凭证规模增加。 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 100,614,468.48 | 48,957,986.85 | 105.51% | 主要是债券借贷业务增加。 |
| 衍生金融负债 | 132,959,084.01 | 282,915,675.53 | -53.00% | 主要是收益互换公允价值变动。 |
| 代理承销证券款 | - | 262,861,469.10 | -100.00% | 支付证券发行款。 |
| 应交税费 | 580,179,800.96 | 969,763,635.48 | -40.17% | 主要是预缴企业所得税。 |
| 应付利息 | 80,007,594.87 | 34,930,908.15 | 129.05% | 主要是短期融资款应付利息增加。 |
| 递延所得税负债 | 158,021,318.48 | 80,422,008.65 | 96.49% | 主要是金融资产公允价值变动产生的递延所得税负债增加。 |
| 其他综合收益 | 488,817,776.13 | 263,190,721.20 | 85.73% | 主要是可供出售金融资产公允价值变动损益增加。 |
| 项目 | 2017年1-3月 | 2016年1-3月 | 增减幅度 | 主要变动原因 |
| 投资收益 | 94,169,460.38 | 514,397,692.24 | -81.69% | 主要是本期金融资产投资收益减少。 |
| 公允价值变动收益（损失） | 336,351,611.30 | -281,913,204.76 | 219.31% | 证券市场波动导致金融工具公允价值变动。 |
| 税金及附加 | 21,238,726.52 | 217,850,106.49 | -90.25% | 主要是实施营改增政策所致。 |
| 资产减值损失 | 30,508,327.24 | 132,073,752.31 | -76.90% | 主要是可供出售金融资产减值损失减少。 |
| 其他业务成本 | 3,514,097.72 | 1,665,594.85 | 110.98% | 主要是投资性房地产折旧及子公司国信期货有限责任公司计提的期货风险准备金增加。 |
| 营业外收入 | 27,914,500.70 | 7,919,136.25 | 252.49% | 主要是收到政府补助增加。 |
| 营业外支出 | 2,818,295.26 | 6,777,380.94 | -58.42% | 主要是捐赠支出减少。 |
| 其他综合收益的税后净额 | 225,627,054.93 | -1,071,968,242.98 | 121.05% | 主要是可供出售金融资产公允价值变动损益增加。 |
| 综合收益总额 | 1,266,424,439.06 | -229,377,667.58 | 652.11% | 主要是可供出售金融资产公允价值变动损益增加。 |
| 每股收益 | 0.13 | 0.10 | 30.00% | 本期净利润增加。 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -2,398,762,076.77 | -4,896,609,564.51 | 51.01% | 主要是代理买卖证券支付的现金净额减少。 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -1,388,161,284.97 | -772,608,254.41 | -79.67% | 主要是偿还到期债券资金流出增加。 |

二、重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

（一）公司 2015 年度配股事项进展情况

2015年5月19日，公司2014年度股东大会审议通过公司2015年度配股相关议案。

2015年6月18日，中国证监会决定受理公司2015年度配股申请。

2015年11月26日，公司收到中国证监会《调查通知书》（稽查总队调查通字[153145]号），因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司立案调查。根据《中国证券监督管理委员会行政许可实施程序规定》相关规定，公司于2016年1月8日向中国证监会申请中止审核2015年度配股。

2016年1月22日，中国证监会同意公司中止审查申请。公司后续将依据中国证监会立案调查结果，决定申请恢复审核或终止审核配股事项。

2016年5月20日，公司2015年度股东大会审议通过将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案。

2017年4月17日，公司第三届董事会第四十次会议审议通过将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案。

上述事项公告详见公司于2015年4月29日、5月16日、5月20日、6月23日，2016年1月23日、5月21日及2017年4月18日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的相关信息。

（二）关于向合格投资者公开发行公司债券的事项

2017年3月23日，中国证监会下发《关于核准国信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2017]385号），核准公司向合格投资者公开发行面值总额不超过180亿元的公司债券，采用分期发行方式。详见公司于2017年3月29日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的《关于向合格投资者公开发行公司债券获中国证券监督管理委员会核准的公告》。

公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）的发行工作已于2017年4月18日结束。本期债券简称为“17国信01”，发行规模为人民币50亿元，票面利率为4.39%。关于本期债券的相关公告详见公司于2017年4月12日、4月14日、4月19日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》披露的相关信息。

（三）发行证券公司短期公司债券的情况

报告期内，公司共发行了1期证券公司短期公司债券，具体情况如下：

| 债券简称 | 起息日 | 到期日 | 发行规模（亿元） | 利率 | 期限 |
|--------|------------|-------------|----------|-------|------|
| 国信1701 | 2017年2月15日 | 2017年11月15日 | 30.00 | 4.35% | 273天 |

（四）关于云南合和承继云南红塔持有的公司股份相关事项的进展情况

公司股东云南红塔唯一股东云南合和为了进一步理顺其内部管理关系及产权管理，提高公司治理水

平，决定对云南红塔进行吸收合并。该吸收合并完成后，云南红塔全部资产、负债均由云南合和承继。据云南省工商行政管理局出具的《准予注销登记通知书》（（云）登记内注核字[2016]第9072号），云南红塔已准予注销登记。云南合和因吸收合并云南红塔而承继云南红塔原持有的公司股份构成持有证券公司5%以上股权的股东变更，因此本次权益变更尚需取得中国证监会的核准。详见公司于2016年6月8日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》披露的《关于股东完成工商登记注销的公告》及《简式权益变动报告书》。

截至本报告披露日，云南合和承继云南红塔持有的公司股份事项正在中国证监会审核中。

（五）关于公司收到中国证监会《调查通知书》相关事项的进展情况

公司于2015年11月26日收到中国证监会《调查通知书》（稽查总队调查通字[153145]号），公司系在开展融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”的规定而被立案调查。详细情况请参见公司于2015年11月27日、11月29日发布的《国信证券股份有限公司公告》。截至本报告披露日，公司尚未收到中国证监会的调查结果。

（六）营业网点的情况

截至报告期末，公司共设有51家分公司，166家证券营业部，分布于全国119个中心城市地区。报告期内，公司营业网点的变更情况如下：

| 变更类型 | 变更后 | 变更前 |
|-------|--|--|
| 迁址 | 国信证券股份有限公司黑龙江分公司 地址：哈尔滨市南岗区国民街23号大庆宾馆15层 | 国信证券股份有限公司黑龙江分公司 地址：哈尔滨市道里区田地街副24-6号1-5层1号 |
| 迁址并更名 | 国信证券股份有限公司江门白石大道证券营业部 地址：江门市蓬江区白石大道120号201室（自编之二） | 国信证券股份有限公司江门迎宾大道证券营业部 地址：江门市蓬江区迎宾大道中131号第4层407号 |

（七）其他

| 序号 | 重要事项概述 | 披露日期 | 临时报告披露网站查询索引 |
|----|-----------------------------------|-----------------|---|
| 1 | 关于“15 国信 01”次级债券赎回结果及摘牌公告 | 2017 年 2 月 3 日 | 详细请参见披露于深交所网站（ www.szse.cn ）的公告。 |
| 2 | 关于国信香港 2017 年度为其全资子公司常规性业务提供担保的公告 | 2017 年 3 月 17 日 | |
| 3 | 关于“15 国信 05”次级债券赎回结果及摘牌公告 | 2017 年 4 月 21 日 | |

三、公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内超期未履行完毕的承诺事项

报告期内，不存在公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内超期未履行完毕的承诺事项。

四、对 2017 年 1-6 月经营业绩的预计

不适用。

五、以公允价值计量的金融资产

单位：人民币万元

| 资产类别 | 初始投资成本 | 本期公允价值变动损益 | 计入权益的累计公允价值变动 | 报告期内购入金额 | 报告期内售出金额 | 累计投资收益 | 期末金额 | 资金来源 |
|--------|--------------|------------|---------------|--------------|--------------|------------|--------------|------|
| 股票 | 745,916.87 | 22,069.92 | 44,439.66 | 221,424.00 | 289,216.95 | -2,017.05 | 781,927.41 | 自有 |
| 基金 | 176,509.30 | 200.30 | 141.37 | 2,590,695.52 | 2,803,883.06 | 1,342.67 | 179,665.84 | 自有 |
| 债券 | 2,712,312.69 | -4,346.69 | -3,357.23 | 1,404,661.70 | 1,602,659.41 | 14,199.09 | 2,677,519.92 | 自有 |
| 信托产品 | 30,475.88 | -381.15 | 51.33 | 894.20 | 2,922.36 | 505.40 | 31,570.00 | 自有 |
| 金融衍生工具 | - | 15,577.51 | - | - | - | -11,326.24 | -13,112.15 | 自有 |
| 其他 | 936,040.06 | 516.39 | -36,209.03 | 62,403.64 | 309,174.08 | -1,590.91 | 894,155.26 | 自有 |
| 合计 | 4,601,254.80 | 33,636.28 | 5,066.10 | 4,280,079.06 | 5,007,855.86 | 1,112.96 | 4,551,726.28 | - |

六、违规对外担保情况

报告期内，公司无违规对外担保情况。

七、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，不存在控股股东及其关联方非经营性占用公司资金的情况。

八、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

| 接待时间 | 接待方式 | 接待对象类型 | 接待对象 |
|-----------------|------|--------|---|
| 2017 年 2 月 28 日 | 实地调研 | 机构 | 华泰证券股份有限公司 广发证券股份有限公司 中国东方资本投资集团 武信投资控股（深圳）股份有限公司 广东惠正投资管理有限公司 深圳市玖歌资本管理有限公司 深圳乾明资产管理有限公司 |

公司已在深交所互动易国信证券专网的投资者关系专区及公司官网就上述调研活动披露投资者关系活动记录表。

国信证券股份有限公司

法定代表人：何如

董事会批准报送日期：2017年4月24日