

证券代码：002500

证券简称：山西证券

公告编号：定 2017—三季报

山西证券股份有限公司 2017 年第三季度报告正文

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。

公司负责人侯巍先生、主管会计工作负责人樊廷让先生及会计机构负责人张立德先生声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

本报告已经公司第三届董事会第二十六次会议审议通过。会议应参加董事 10 名，实际参加董事 10 名（其中，侯巍董事长、樊廷让董事、赵树林董事现场出席会议；周宜洲董事、傅志明董事、王卫国独立董事、蒋岳祥独立董事、容和平独立董事电话参会；因工作原因，柴宏杰董事书面委托侯巍董事、朱海武独立董事书面委托蒋岳祥独立董事代为出席会议并行使表决权）。

公司 2017 年第三季度财务报告未经会计师事务所审计。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

是 否

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增 减	
总资产（元）	52,677,855,833	48,057,678,145	9.61%	
归属于上市公司股东的净资产（元）	12,439,912,177	12,278,084,456	1.32%	
	本报告期	本报告期比上年同期 增减	年初至报告期末	年初至报告期末比上 年同期增减
营业收入（元）	1,301,539,055	97.91%	3,400,544,538	113.72%
归属于上市公司股东的净利润（元）	141,837,472	-0.62%	379,221,463	17.02%
归属于上市公司股东的扣除非经常 性损益的净利润（元）	141,621,114	-2.11%	378,434,507	18.51%
经营活动产生的现金流量净额（元）	-	-	-59,701,658	不适用
基本每股收益（元/股）	0.0501	-1.96%	0.1341	15.60%
稀释每股收益（元/股）	0.0501	-1.96%	0.1341	15.60%
加权平均净资产收益率	1.15%	减少 0.04 个百分点	3.06%	增长 0.47 个百分点

截止披露前一交易日的公司总股本：

截止披露前一交易日的公司总股本（股）	2,828,725,153	
	本报告期	年初至报告期末
用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股）	0.0501	0.1341

非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元

项目	年初至报告期期末金额	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	707,028	-
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）	2,032,538	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-1,687,057	-
小计	1,052,509	-

减：所得税影响额	-265,553	-
少数股东权益影响额（税后）	-	-
合计	786,956	--

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的说明：

项目	涉及金额（元）	原因
交易性金融工具、衍生金融工具、可供出售金融资产的投资收益	765,443,046	由于证券投资业务为本公司的主营业务，因此持有以及处置交易性金融工具、衍生金融工具及处置可供出售金融资产取得的投资收益不界定为非经常性损益。
交易性金融工具及衍生金融工具公允价值变动损益	12,603,471	由于证券投资业务为本公司的主营业务，因此持有交易性金融工具及衍生金融工具产生的公允价值变动损益不界定为非经常性损益。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东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	166,019 户	报告期末表决权恢复的优先股股东总数	0 户			
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	
					股份状态	数量
山西金融投资控股集团有限公司	国有法人	30.42%	860,395,355	-	-	-
太原钢铁（集团）有限公司	国有法人	9.99%	282,605,635	-	-	-
山西国际电力集团有限公司	国有法人	7.04%	199,268,856	-	-	-
北京中吉金投资管理有限公司 一中吉金投一稳赢2号投资基金	基金、理财产品等	1.81%	51,145,000	-	-	-
河南省安融房地产开发有限公司	境内一般法人	1.64%	46,522,351	-	质押	41,670,000
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	1.44%	40,619,400	-	-	-

中国人寿保险股份有限公司一分红一个人分红-005L-FH002 深	基金、理财产品等	1.23%	34,822,464	-	-	-
长安国际信托股份有限公司—长安信托—长安投资 826 号证券投资集合资金信托计划	基金、理财产品等	0.95%	26,977,618	-	-	-
郑州市热力总公司	国有法人	0.93%	26,401,342	-	-	-
中欧盛世资产—民生银行—中欧盛世博恩晋源 1 号资产管理计划	基金、理财产品等	0.88%	24,780,251	-	-	-
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			
山西金融投资控股集团有限公司	860,395,355	人民币普通股	860,395,355			
太原钢铁（集团）有限公司	282,605,635	人民币普通股	282,605,635			
山西国际电力集团有限公司	199,268,856	人民币普通股	199,268,856			
北京中吉金投资资产管理有限公司—中吉金投—稳赢 2 号投资基金	51,145,000	人民币普通股	51,145,000			
河南省安融房地产开发有限公司	46,522,351	人民币普通股	46,522,351			
中央汇金资产管理有限责任公司	40,619,400	人民币普通股	40,619,400			
中国人寿保险股份有限公司一分红一个人分红-005L-FH002 深	34,822,464	人民币普通股	34,822,464			
长安国际信托股份有限公司—长安信托—长安投资 826 号证券投资集合资金信托计划	26,977,618	人民币普通股	26,977,618			
郑州市热力总公司	26,401,342	人民币普通股	26,401,342			
中欧盛世资产—民生银行—中欧盛世博恩晋源 1 号资产管理计划	24,780,251	人民币普通股	24,780,251			
上述股东关联关系或一致行动的说明	无					
前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明（如有）	公司前 10 名股东不存在将所持股份用于融资融券业务中的冲抵保证金证券的情形。					

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

是 否

2、公司优先股股东总数及前 10 名优先股股东持股情况表

适用 不适用

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

√适用 □ 不适用

报告期主要会计报表项目、财务指标与上年度期末或上年同期相比增减变动幅度超过 30%的项目情况

单位：元

项目	2017年9月30日	2016年12月31日	增减	变动原因
客户备付金	1,248,857,739	1,918,929,941	-34.92%	在登记公司存款减少
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	16,583,544,916	10,852,322,071	52.81%	库存证券规模增加
应收款项	213,641,050	329,026,734	-35.07%	应收交易款项减少
存出保证金	3,744,350,515	2,067,581,176	81.10%	期货交易保证金增加
可供出售金融资产	1,646,868,201	4,006,442,592	-58.89%	库存证券规模减少
递延所得税资产	49,701,817	71,444,364	-30.43%	金融工具公允价值变动影响
其他资产	1,039,769,338	795,460,524	30.71%	开放式基金过渡户影响
应付短期融资款	3,164,900,000	4,806,760,000	-34.16%	收益凭证规模减少
拆入资金	4,395,000,000	3,000,000,000	46.50%	报告期向证金公司拆入资金增加
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	120,998,660	219,821,850	-44.96%	卖空交易性债券减少
应付职工薪酬	127,822,780	251,760,152	-49.23%	报告期发放上年度奖金
应交税费	47,125,436	92,050,900	-48.81%	报告期内所得税汇算清缴及子公司购买仓单业务增值税进项税额增加影响
应付款项	53,362,363	35,055,849	52.22%	应付交易款项增加
应付债券	3,199,764,151	1,697,801,993	88.47%	报告期偿还次级债、公司债及新发行公司债券和一年以上收益凭证影响
递延所得税负债	10,986,354	6,791,977	61.75%	金融工具公允价值变动影响
其他综合收益	-2,850,149	-42,477,191	不适用	可供出售金融资产公允价值变动影响
项目	2017年1-9月	2016年1-9月	增减	变动原因
利息净收入	48,339,809	207,726,249	-76.73%	债券回购业务利息支出增加
投资收益	765,443,046	264,845,025	189.02%	固定收益业务收益增加

公允价值变动收益	12,603,471	-82,510,804	不适用	交易性金融工具公允价值变动影响
汇兑收益	-819,292	604,194	-235.60%	汇率变动影响
其他业务收入	1,693,189,313	168,656,284	903.93%	报告期仓单业务收入增加
其他收益	2,032,538	-	不适用	根据新发布政府补助准则确认收到税费返还的影响
税金及附加	17,635,606	50,685,440	-65.21%	营改增科目内容变更影响
资产减值损失	128,169,039	12,070,196	961.86%	报告期融出资金和可供出售金融资产减值准备增加
其他业务成本	1,677,754,062	162,792,186	930.61%	报告期仓单业务成本增加
营业外支出	2,307,026	6,147,743	-62.47%	报告期捐赠支出和固定资产处置损失减少
可供出售金融资产公允价值变动损益	54,793,132	-242,011,917	不适用	可供出售金融资产公允价值变动影响
外币财务报表折算差额	-15,166,090	6,431,621	-335.81%	汇率变动影响
项目	2017年1-9月	2016年1-9月	增减	变动原因
经营活动产生的现金流量净额	-59,701,658	-2,800,725,795	不适用	融出资金净增加、代理买卖证券款净增加、回购业务资金净增加、卖出可供出售金融资产及买入交易性金融资产影响
投资活动产生的现金流量净额	-142,809,792	-1,967,001,988	不适用	本年三个月及以上定期存款变动影响
筹资活动产生的现金流量净额	-563,359,843	-4,610,505,324	不适用	本年偿还次级债、公司债及发行收益凭证与公司债影响
汇率变动对现金的影响	-15,343,092	604,194	-2639.43%	汇率变动影响

二、重要事项进展情况及影响和解决方案的分析说明

√ 适用 □ 不适用

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	公司债券事项 2017年8月4日,公司于2014年8月4日发行的“14山证01”已期满3年。根据公司“14山证01”《公开发行公司债券募集说明书》和《公司债券上市公告书》有关条款的规定,“14山证01”已于2017年8月2日摘牌,并于8月4日兑付(详见公告:临2017-041)。	2017.07.27	巨潮资讯网 (http://www.cninfo.com.cn)
2	公司获准设立11家分支机构事项	2017.08.11	

	<p>2017年8月,公司收到中国证券监督管理委员会山西监管局《关于核准山西证券股份有限公司设立11家分支机构的批复》(晋证监许可字[2017]8号)。</p> <p>根据该批复,公司获准设立11家证券营业部。</p> <p>公司将依法依规为新设分支机构配备人员,健全完善制度、业务设施和信息系统。</p> <p>公司将自批复下发之日起6个月内完成分支机构设立及工商登记事宜,并按照要求到山西证监局申领《经营证券期货业务许可证》(详见公告:临2017-045)。</p> <p>截止本报告披露日,有7家分支机构已领取《营业执照》和《经营证券期货业务许可证》。</p>		
3	<p>公司上海资产管理分公司获得经营证券期货业务许可证事项</p> <p>根据中国证券监督管理委员会山西监管局《关于核准山西证券股份有限公司设立上海资产管理分公司的批复》(晋证监许可字[2017]5号)要求,公司上海资产管理分公司已完成设立工作,并领取了《营业执照》和《经营证券期货业务许可证》(详见公告:临2017-049)。</p>	2017.08.31	
4	<p>公司控股子公司山证国际资产管理有限公司取得合格境外机构投资者资格事项</p> <p>报告期内,公司控股子公司山证国际资产管理有限公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准山证国际资产管理有限公司合格境外机构投资者资格的批复》(证监许可[2017]1501号,以下简称“批复”),核准公司控股子公司山证国际资产管理有限公司合格境外机构投资者资格。</p> <p>根据批复,山证国际资产管理有限公司在开展合格境外机构投资者业务的过程中,将严格遵守有关规定,依法履行职责、承担责任(详见公告:临2017-051)。</p>	2017.09.07	

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

√ 适用 □ 不适用

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	太原钢铁(集团)有限公司	关于规范关联交易的承诺	太原钢铁(集团)有限公司及其附属公司、参股公司将遵循公开、公平、公正的原则及公允、合理的市场价格与公司进行交易,根据相关规定履行关联交易决策程序,履行信息披露义务。	2012.10.18	长期	报告期内,太原钢铁(集团)有限公司及其附属公司、参股公司按照《关于规范关联交易的承诺函》中的规定履行义务。
	山西国际电力集团有限公司	关于规范关联交易的承诺	山西国际电力集团有限公司及其附属公司、参股公司将遵循公开、公平、公正的原则及公允、合理的市场价格与公司进行交易,根据相关规定履行关联	2012.10.18	长期	报告期内,山西国际电力集团有限公司及其附属公司、参股公司按

			交易决策程序，履行信息披露义务。			照《关于规范关联交易的承诺函》中的规定履行义务。
	山西金融投资控股集团有限公司	1、关于上市公司独立性的承诺	山西金融投资控股集团有限公司及其直接、间接控制的任何公司、企业及其他单位将充分尊重山西证券的独立法人地位，严格遵守山西证券的公司章程，保证山西证券独立经营、自主决策，保证山西证券资产完整，人员、财务、机构和业务独立。本公司及本公司直接、间接控制的任何公司、企业及其他单位将严格按照《公司法》、《证券法》、中国证监会及证券交易所相关规定及山西证券公司章程的要求，依法履行应尽的诚信勤勉职责；	2016.02.02	长期	报告期内，山西金融投资控股集团有限公司及其直接、间接控制的任何公司、企业及其他单位履行了《关于保持上市公司独立性承诺函》、《关于规范关联交易的承诺函》、《关于避免同业竞争的承诺函》中规定的义务。
		2、关于规范关联交易的承诺	山西金融投资控股集团有限公司及其直接、间接控制的任何公司、企业及其他单位将尽力避免及规范与山西证券及其子公司的关联交易；对于无法避免或必要的关联交易，将本着公平、公开、公正的原则确定关联交易价格，保证关联交易的公允性；			
		3、关于避免同业竞争的承诺	山西金融投资控股集团有限公司及其直接、间接控制的任何公司、企业及其他单位不会在中国境内以任何形式从事与山西证券及其子公司构成竞争或可能构成竞争的业务和经营；不会在中国境内以任何形式支持山西证券以外的他人从事与山西证券开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务及以其他方式参与（不论直接或间接）任何与山西证券开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务或活动；山西金融投资控股集团有限公司保证，不利用对山西证券的控制关系，从事或参与从事有损山西证券、山西证券子公司以及山西证券其他股东利益的行为。			
资产重组时所作承诺	河南省安融房地产开发有限公司	关于格林期货自有物业和租赁物业的承诺	格林期货原股东于2012年9月28日出具《格林期货有限公司股东关于格林期货有限公司自有物业与租赁物业情况的承诺函》，承诺就上述未办理土地使用权的房产，将督促格林期货及时办理该等房产占用范围内的土地使用权登记、取得对应的土地使用权属证书，若格林期货因该等房产占用范围内的土地使用权未能办理登记而导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。如果在租赁期限内，因抵押权人行使抵押权及租赁房屋未取得《房屋所有权证》导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。	2012.09.28.	长期	正在履行
	郑州市热力总公司	关于格林期货自有	格林期货原股东于2012年9月28日出具《格林期货有限公司股东关于格林期货有限公司自有物业	2012.09.28.	长期	正在履行

		物业和租赁物业的承诺	与租赁物业情况的承诺函》，承诺就上述未办理土地使用权的房产，将督促格林期货及时办理该等房产占用范围内的土地使用权登记、取得对应的土地使用权属证书，若格林期货因该等房产占用范围内的土地使用权未能办理登记而导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。如果在租赁期限内，因抵押权人行使抵押权及租赁房屋未取得《房屋所有权证》导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。			
	上海捷胜环保科技有限公司	关于格林期货自有物业和租赁物业的承诺	格林期货原股东于2012年9月28日出具《格林期货有限公司股东关于格林期货有限公司自有物业与租赁物业情况的承诺函》，承诺就上述未办理土地使用权的房产，将督促格林期货及时办理该等房产占用范围内的土地使用权登记、取得对应的土地使用权属证书，若格林期货因该等房产占用范围内的土地使用权未能办理登记而导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。如果在租赁期限内，因抵押权人行使抵押权及租赁房屋未取得《房屋所有权证》导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。	2012.09.28.	长期	正在履行
	玺萌融投资控股有限公司	关于格林期货自有物业和租赁物业的承诺	格林期货原股东于2012年9月28日出具《格林期货有限公司股东关于格林期货有限公司自有物业与租赁物业情况的承诺函》，承诺就上述未办理土地使用权的房产，将督促格林期货及时办理该等房产占用范围内的土地使用权登记、取得对应的土地使用权属证书，若格林期货因该等房产占用范围内的土地使用权未能办理登记而导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。如果在租赁期限内，因抵押权人行使抵押权及租赁房屋未取得《房屋所有权证》导致格林期货遭受任何损失，则格林期货原股东将对该等损失承担连带赔偿责任。	2012.09.28.	长期	正在履行
对债券持有人所作承诺	山西证券股份有限公司	对债券持有人所作承诺	2014年公司债券（第一期）在出现预计不能按期偿还债券本息或者到期未能按期偿付债券本息时，公司将至少采取如下措施：1、不向股东分配利润；2、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施；3、调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金；4、主要责任人不得调离。	2014.07.31	2014年公司债券（第一期）存续期限内	公司已于2017年8月4日按期偿还债券本息。
			2017年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）在出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息的情况时，公司将至少采取如下保障措施：1、不向股东分配利润；2、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施；3、	2017.03.13	2017年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）存续期限	报告期内，公司未发生不能按期偿还债券本息的情况。

			调减或停发董事和高级管理人员的工资和奖金；4、 与公司债券相关的公司主要责任人不得调离。		内	
承诺是否按时履行	是					

四、对 2017 年度经营业绩的预计

公司主营业务收入受证券市场影响较大，无法做出准确业绩预测。

五、以公允价值计量的金融资产

适用 不适用

单位：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	1,234,746,349	-35,176,849	95,214,318	6,250,259,529	6,528,891,034	41,726,701	1,110,656,691	自有
基金	854,226,930	2,752,144	1,857,893	849,712,036	1,014,910,966	11,444,990	703,104,758	自有
债券	15,005,040,060	20,581,493	3,381,935	410,470,302,693	405,563,604,530	623,432,962	15,001,808,695	自有
信托产品	67,373,600	-	-	-	7,500,000	3,803,737	59,873,600	自有
期货	-	26,519,046	-	-	-	10,576,843	-	自有
金融衍生工具	-	-2,190,440	-	-	-	-7,219,729	-	自有
其他	1,260,167,427	118,077	-2,865,407	1,583,702,700	3,120,810,000	72,581,177	1,354,969,373	自有
合计	18,421,554,366	12,603,471	97,588,739	419,153,976,958	416,235,716,530	756,346,681	18,230,413,117	-

六、违规对外担保情况

适用 不适用

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

适用 不适用

八、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

适用 不适用

接待时间	接待方式	接待对象类型	调研的基本情况索引
2017.07.01-2017.09.30	电话沟通	个人	公司经营情况、行业状况及公司公告内容

2017.7.14	现场调研	特定对象调研	有关本次调研详细情况公司已按照相关规定,于2017年7月18日披露在深交所互动易公司专网(http://irm.cninfo.com.cn/ssessgs/S002500/),详见“投资者关系”栏目《2017年7月14日投资者关系活动记录表》
-----------	------	--------	---

山西证券股份有限公司
法定代表人：侯巍
二零一七年十月二十三日