北京高华证券有限责任公司

2016 年度专项合并报表及独立鉴证报告

北京高华证券有限责任公司

2016 年度专项合并报表及独立鉴证报告

内容	页码
独立鉴证报告	1 至 3
专项合并资产负债表	4
专项合并利润表	5
专项合并净资本计算表	6
专项合并风险资本准备计算表	7 至 8
专项合并风险控制指标监管报表	9 至 10
专项合并报表编制基础说明	11
专项合并风险控制指标监管报表附注	12 至 13

普华永道

2016 年度专项合并报表及独立鉴证报告

普华永道中天特审字(2017)第 1408 号

北京高华证券有限责任公司董事会：

我们审计了北京高华证券有限责任公司(以下简称“北京高华”)2016 年 12 月 31 日的合并及公司资产负债表、2016 年度的合并及公司利润表、合并及公司现金流量表、合并及公司所有者权益变动表和财务报表附注(以下简称“北京高华财务报表”)，并于 2017 年 4 月 26 日出具了报告号为普华永道中天审字(2017)第 24881 号的标准无保留意见的审计报告。北京高华财务报表的编制是北京高华管理层的责任，我们的责任是在按照中国注册会计师审计准则实施审计工作的基础上，对北京高华财务报表整体发表审计意见。

我们审计了高盛高华证券有限责任公司(以下简称“高盛高华”)2016 年 12 月 31 日资产负债表、2016 年度利润表、现金流量表、所有者权益变动表和财务报表附注(以下简称“高盛高华财务报表”)，并于 2017 年 4 月 26 日出具了报告号为普华永道中天审字(2017)第 24879 号的标准无保留意见的审计报告。高盛高华财务报表的编制是高盛高华管理层的责任，我们的责任是在按照中国注册会计师审计准则实施审计工作的基础上，对高盛高华财务报表整体发表审计意见。

在对上述财务报表实施审计的基础上，我们接受委托，对后附北京高华 2016 年度专项合并财务报表(包括 2016 年 12 月 31 日专项合并资产负债表及 2016 年度专项合并利润表)和 2016 年 12 月 31 日专项合并风险控制指标监管报表(包括专项合并净资本计算表、专项合并风险资本准备计算表及专项合并风险控制指标监管报表)(以下合称“专项合并报表”)执行了有限保证鉴证业务。

管理层对专项合并报表的责任

根据中国证券监督管理委员会颁布的《关于明确证券公司分类评价工作中有关事项的函》(机构部部函[2009]552 号)、中国证券监督管理委员会机构监管部和会计部联合制定的《证券公司年报监管工作指引第 1 号—基本工作要点》、《关于修改〈证券公司风险控制指标管理办法〉的决定》(证监会令第 125 号)、《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告[2016]10 号)和《关于证券公司风险控制指标监管报表填报有关事项的通知》(机构部函[2016]2489 号) (以下合称“证监会规定”)的规定编制和列报专项合并报表是北京高华管理层的责任。这种责任包括设计、执行和维护与编制和列报专项合并报表有关的内部控制以使专项合并报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报、采用适当的编制基础，以及根据情况作出合理估计。

注册会计师的责任

我们的责任是在执行鉴证工作的基础上对专项合并报表发表结论，并按照双方同意的业务约定条款，仅对北京高华报告我们的结论，除此之外并无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他方承担责任或义务。

我们根据《中国注册会计师其他鉴证业务准则第 3101 号—历史财务信息审计或审阅以外的鉴证业务》的规定执行了鉴证工作。该准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施鉴证工作，以就我们是否注意到任何事项使我们相信专项合并报表未能在所有重大方面按照证监会规定编制和列报获取有限保证。

相比合理保证鉴证业务，有限保证鉴证业务的收集证据程序更为有限，因而获得的保证程度要低于合理保证的鉴证业务。选择的鉴证程序取决于注册会计师的判断，包括对专项合并报表未能在所有重大方面按照证监会规定编制和列报风险的评估。在我们的鉴证工作范围内，我们对专项合并报表实施了以下工作程序：

(1) 向北京高华有关人员询问专项合并财务报表的编制基础；
(2) 将 2016 年 12 月 31 日专项合并资产负债表和 2016 年度专项合并利润表编制过程中采用的被纳入合并范围的两家证券公司的财务数据，与这两家证券公司经审计的 2016 年度财务报表进行核对，并复核合并抵销分录编制的适当性；

(3) 了解专项合并风险控制指标监管报表的编制基础，复核专项合并风险控制指标监管报表的计算公式，将编制专项合并风险控制指标监管报表时所使用的财务报表相关信息与经审计财务报表进行核对和重新计算等我们认为必要的程序。

结论

基于我们执行的有限责任鉴证工作，我们没有注意到任何事项使我们相信专项合并报表未能在所有重大方面按照证监会规定编制和列报。

使用和分发限制

本报告仅供贵公司向中国证券监督管理委员会及其派出机构呈报使用，不得用于任何其他目的。本报告非为其他目的编制，也不能为其他目的分发或使用。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师 叶少宽

中国•上海市
2017 年 4 月 26 日

注册会计师 孟 南

北京高华证券有限责任公司

专项合并资产负债表
2016 年 12 月 31 日
(金额单位：人民币元)

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资产		
货币资金	3,526,061,418.69	5,702,119,837.47
其中：客户存款	36,495,062.28	296,306,963.12
结算备付金	769,658,560.96	847,405,006.61
其中：客户备付金	36,159,445.91	3,956,835.06
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	374,795,558.67	504,089,577.40
衍生金融资产	9,508,300.60	35,772,519.88
应收款项	18,238,810.53	70,242,223.73
应收利息	2,377,490.50	14,644,467.82
存出保证金	137,636,144.27	81,386,792.15
长期股权投资	235,895,773.28	235,895,773.28
固定资产	42,295,659.10	18,359,396.92
在建工程	15,787,881.57	15,964.02
无形资产	68,465,222.05	68,744,630.32
递延所得税资产	88,641,428.67	71,974,622.44
其他资产	29,470,266.41	16,886,857.14
资产总计	5,318,832,515.30	7,667,537,669.18
负债		
短期借款	-	100,000,000.00
衍生金融负债	4,820,394.98	23,578,360.09
代理买卖证券款	72,654,508.19	300,263,798.18
应付职工薪酬	461,826,855.27	435,505,607.76
应交税费	24,244,449.35	9,242,881.93
应付款项	1,951,088.48	6,362,850.59
应付利息	4,417,180.56	26,393,354.99
长期借款	1,500,000,000.00	3,500,000,000.00
其他负债	41,564,385.27	78,261,923.87
负债合计	2,111,478,862.10	4,479,608,777.41
股东权益		
实收资本	1,072,000,000.00	1,072,000,000.00
一般风险准备	306,551,704.37	295,831,147.13
盈余公积	159,443,785.30	154,083,506.68
未分配利润	1,231,616,539.95	1,231,201,162.82
归属于母公司股东权益合计	2,769,612,029.62	2,753,115,816.63
少数股东权益	437,741,623.58	434,813,075.14
股东权益合计	3,207,353,653.20	3,187,928,891.77
负债和股东权益总计	5,318,832,515.30	7,667,537,669.18

企业负责人：　　财务负责人：　　会计机构负责人：

北京高华证券有限责任公司

专项合并利润表
2016年度
(金额单位：人民币元)

	2016年度	2015年度
一、营业收入	943,123,846.83	1,610,915,017.16
手续费及佣金净收入	1,016,324,407.04	1,238,829,640.51
其中：经纪业务手续费净收入	164,475,386.61	330,167,461.61
投资银行业务手续费净收入	173,399,229.63	334,213,510.60
资产管理业务手续费净收入	12,476,038.98	94,252,614.36
利息净支出	(102,718,685.85)	(156,496,450.18)
投资收益	27,210,305.36	515,415,202.26
公允价值变动(损失)/收益	(2,040,552.34)	9,449,205.73
汇兑收益	4,348,372.62	3,717,418.84
二、营业支出	(863,770,006.27)	(889,816,975.58)
税金及附加	(25,233,026.88)	(109,247,883.84)
业务及管理费	(838,536,979.39)	(780,569,091.74)
三、营业利润	79,353,840.56	721,098,041.58
加：营业外收入	3,612,384.92	3,450,367.57
减：营业外支出	(36,162.09)	(305,834.66)
四、利润总额	82,930,063.39	724,242,574.49
减：所得税费用	(20,452,888.00)	(187,167,494.64)
五、净利润	62,477,175.39	537,075,079.85
其中：归属于母公司股东的净利润	59,548,626.95	525,036,569.52
少数股东损益	2,928,548.44	12,038,510.33
六、其他综合收益	-	-
七、综合收益总额	62,477,175.39	537,075,079.85
其中：归属于母公司股东的综合收益总额	59,548,626.95	525,036,569.52
归属于少数股东的综合收益总额	2,928,548.44	12,038,510.33

企业负责人：　　财务负责人：　　会计机构负责人：

北京高华证券有限责任公司

专项合并净资本计算表

2016年12月31日

(金额单位：人民币元)

项目	行次	年初余额	年末余额	扣减比例	应计算的金额 年初余额	应计算的金额 年末余额
净资产	1	**3,187,928,891.77**	**3,207,353,653.20**		**3,187,928,891.77**	**3,207,353,653.20**
减：优先股及永续次级债等	2	-	-	**100%**	-	-
减：资产项目的风险调整合计	3	**495,028,164.86**	**602,603,035.21**		**452,306,996.71**	**539,234,410.94**
存出保证金	4	81,386,792.15	137,636,144.27		38,665,624.00	74,267,520.00
其中：履约保证金	5	-	-	10%	-	-
期货保证金	6	38,665,624.00	74,267,520.00	100%	38,665,624.00	74,267,520.00
其他存出保证金	7	14,792,074.76	19,282,089.63		-	-
长期股权投资	8	235,895,773.28	235,895,773.28	100%	235,895,773.28	235,895,773.28
投资性房地产、固定资产	9	18,375,360.94	58,083,540.67	100%	18,375,360.94	58,083,540.67
其他	10	159,370,238.49	170,987,576.99	100%	159,370,238.49	170,987,576.99
减：或有负债的风险调整合计	11	-	-		-	-
对外担保金额及担保承	12	-	-	100%	-	-
其他或有负债	13	-	-	100%	-	-
加：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计	14	-	-		-	-
母公司提供的担保承诺	15	-	-	100%	-	-
其他项目	16	-	-		-	-
减：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计	17	-	-		-	-
所有权受限等无法变现的资产(如被冻结)	18	-	-	100%	-	-
其他项目	19	-	-		-	-
核心净资本	20				**2,735,621,895.06**	**2,668,119,242.26**
加：附属净资本	21	**3,500,000,000.00**	**1,500,000,000.00**		**2,650,000,000.00**	**1,250,000,000.00**
借入的次级债(含永续次级债)	22	3,500,000,000.00	1,500,000,000.00		2,650,000,000.00	1,250,000,000.00
中国证监会认定或核准的其他调整项目	23	-	-		-	-
净资本	24				**5,385,621,895.06**	**3,918,119,242.26**

附 1：期末或有事项

无

附 2：其他需要说明的事项

本公司于2008年4月1日、2008年7月3日及2010年4月29日分别借入人民币5亿元整、5亿元整、10亿元整的次级债务，期限均为10年。其中前两笔已于2016年6月1日提前偿还。子公司高盛高华于2007年12月28日、2008年12月10日及2010年4月28日分别借入三笔人民币5亿元整的次级债务，前两笔期限均为10年，第三笔到期日与第二笔相同。其中前两笔已于2016年12月27日和2016年12月9日提前偿还。本公司及高盛高华借入的次级债务均为以现金方式借入。本公司存续的次级债务按100%计入净资本。高盛高华存续的次级债务按50%计入净资本。

企业负责人：　　财务负责人：　　会计机构负责人：

北京高华证券有限责任公司

专项合并风险资本准备计算表

2016 年 12 月 31 日

(金额单位：人民币元)

项目	行次	年初余额	年末余额	计算标准	风险资本准备 年初余额	风险资本准备 年末余额
1. 市场风险资本准备	1	**594,454,407.40**	**460,479,431.67**		**54,480,317.61**	**73,358,010.13**
其中:(1)权益类证券及其衍生品规模	2	**264,746,253.00**	**430,475,830.63**		**43,080,142.58**	**67,357,830.08**
上海 180 指数、深圳 100 指数、沪深 300 指数成分股	3	220,047,777.93	374,777,689.18	15%	33,007,166.69	56,216,653.38
一般上市股票	4	11,333,226.90	13,569.07	30%	3,399,968.07	4,070.72
流通受限的股票	5	-	-	50%	-	-
其他股票	6	-	373.49	80%	-	298.79
权益类基金	7	418.17	325.89	10%	41.82	32.59
其中：分级基金中的非优先级基金	8	-	-	30%	-	-
股指期货、权益互换及卖出期权	9	33,364,830.00	55,683,873.00	20%	6,672,966.00	11,136,774.60
买入期权	10	-	-	100%	-	-
其他	11	-	-		-	-
(2)非权益类证券及其衍生品规模	12	**329,708,154.40**	**30,003,601.04**		**11,400,175.03**	**6,000,180.05**
国债、中央银行票据、国开债	13	272,704,653.88	-	0%	-	-
政策性金融债、政府支持机构债券	14	-	-	2%	-	-
地方政府债	15	-	-	5%	-	-
信用评级 AAA 级的信用债券	16	-	-	10%	-	-
信用评级 AAA 级以下，AA 级(含)以上的信用债券	17	-	-	15%	-	-
信用评级 AA 级以下，BBB 级(含)以上的信用债券	18	-	-	50%	-	-
信用评级 BBB 级以下的信用债券	19	-	-	80%	-	-
非权益类基金	20	-	-	10%	-	-
其中：货币基金	21	3,500.52	3,601.04	5%	175.03	180.05
国债期货、债券远期及利率互换	22	57,000,000.00	30,000,000.00	20%	11,400,000.00	6,000,000.00
集合及信托等产品	23	-	-		-	-
其中：未约定先行承担亏损	24	-	-	25%	-	-
约定先行承担亏损	25	-	-	50%	-	-
定向产品	26	-	-	50%	-	-
大宗商品现货(含黄金)	27	-	-	8%	-	-
大宗商品衍生品	28	-	-	20%	-	-
其他	29	-	-		-	-
(3)已对冲风险的权益类证券及其衍生品	30	-	-		-	-
权益类证券	31	-	-	5%	-	-
权益类衍生品	32	-	-	5%	-	-
(4)已对冲风险的非权益类证券及其衍生品	33	-	-		-	-
非权益类证券	34	-	-	1%	-	-
非权益类衍生品	35	-	-	1%	-	-

北京高华证券有限责任公司

专项合并风险资本准备计算表(续)
2016 年 12 月 31 日
(金额单位：人民币元)

项目	行次	年初余额	年末余额	计算标准	风险资本准备 年初余额	风险资本准备 年末余额
2. 信用风险资本准备	36	**83,122,562.96**	**36,205,641.17**		**10,981,205.68**	**3,620,564.12**
融资类业务	37	-	-		-	-
其中：场内融资业务	38	-	-	10%	-	-
其中：股票质押回购	39	-	-	20%	-	-
场外融资业务	40	-	-	30%	-	-
应收账款	41	83,122,562.96	36,205,641.17		10,981,205.68	3,620,564.12
其中：账龄 1 年以内(含 1 年)	42	80,157,063.64	36,205,641.17	10%	8,015,706.36	3,620,564.12
账龄 1 年以上、应收股东及其关联公司款项	43	2,965,499.32	-	100%	2,965,499.32	-
其他	44	-	-		-	-
3. 操作风险资本准备	45	**1,238,539,458.04**	**1,370,189,536.85**		**212,003,509.38**	**227,789,147.20**
证券经纪业务净收入	46	114,767,219.60	190,206,466.86	12%	13,772,066.35	22,824,776.02
证券投资咨询业务净收入	47	-	-	12%	-	-
证券承销与保荐业务、财务顾问业务净收入	48	110,333,838.28	198,251,778.53	15%	16,550,075.74	29,737,766.78
证券资产管理业务净收入	49	24,584,824.68	49,500,935.45	15%	3,687,723.70	7,425,140.32
证券自营业务净收入	50	189,385,833.94	315,791,872.46	18%	34,089,450.11	56,842,537.04
融资类业务及其他业务净收入	51	799,467,741.54	616,438,483.55	18%	143,904,193.48	110,958,927.04
4. 特定风险资本准备	52	**2,929,770,512.15**	-		**19,121,850.20**	-
证券公司资产管理业务	53	2,929,770,512.15	-		19,121,850.20	-
其中：结构化集合资管计划	54	894,599,527.96	-	1%	8,945,995.28	-
投资非标资产的定向资管计划	55	-	-	0.9%	-	-
各类私募投资基金(含各类直投基金)	56	-	-	0.7%	-	-
其他定向资管计划	57	2,035,170,984.19	-	0.5%	10,175,854.92	-
分类调整前的各项风险资本准备合计	58				**296,586,882.87**	**304,767,721.45**
分类调整后的各项风险资本准备合计	59				**207,610,818.01**	**213,337,405.02**

注：根据中国证监会公布的合并评价的证券公司分类评级结果，本公司及子公司高盛高华证券有限责任公司合并评级，其中 2016 年度为 A 级，2015 年度、2014 年度及 2013 年度为 AA 级。因此 2016 年 12 月 31 日及 2015 年 12 月 31 日适用分类计算标准均为“连续 3 年为 A”，计算系数为 0.7。

企业负责人:　　财务负责人:　　会计机构负责人:

北京高华证券有限责任公司

专项合并风险控制指标监管报表

2016 年 12 月 31 日

(金额单位：人民币元)

项目	行次	附注	年初余额	年末余额	预警标准 注(1)	监管标准 注(2)
核心净资本	1		2,735,621,895.06	2,668,119,242.26		
附属净资本	2		2,650,000,000.00	1,250,000,000.00		
净资本	3		5,385,621,895.06	3,918,119,242.26		
净资产	4		3,187,928,891.77	3,207,353,653.20		
各项风险资本准备之和	5		207,610,818.01	213,337,405.02		
表内外资产总额	6		7,463,498,242.02	5,331,861,880.11		
风险覆盖率	7		2,594.10%	1,836.58%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	8		36.65%	50.04%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	9		2,708.55%	3,402.66%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	10		507.85%	433.91%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	11		168.94%	122.16%	≥24%	≥20%
净资本/负债	12	(3)	128.86%	192.18%	≥9.6%	≥8%
其中：负债			4,179,344,979.23	2,038,824,353.91		
净资产/负债	13	(3)	76.28%	157.31%	≥12%	≥10%
其中：负债			4,179,344,979.23	2,038,824,353.91		
自营权益类证券及其衍生品 /净资本	14	(4)	4.92%	10.99%	≤80%	≤100%
其中：自营权益类证券及其衍生品			264,746,253.00	430,475,830.63		
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本	15	(4)	6.12%	0.77%	≤400%	≤500%
其中：自营非权益类证券及其衍生品			329,708,154.40	30,003,601.04		
持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名	16	(5)			≤24%	≤30%
其中：	17					
中国平安	18		0.22%	0.25%		
兴业银行	19		0.05%	0.22%		
招商银行	20		0.05%	0.20%		
平安银行	21		0.03%	0.19%		
贵州茅台	22		0.03%	0.18%		

北京高华证券有限责任公司

专项合并风险控制指标监管报表(续)

2016 年 12 月 31 日

(金额单位：人民币元)

项目	行次	附注	年初余额	年末余额	预警标准	监管标准
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名	23	(6)			≤4%	≤5%
其中：	24					
建设银行	25		0.00%	0.01%		
中联重科	26		0.00%	0.01%		
特变电工	27		0.00%	0.01%		
鹏博士	28		0.00%	0.01%		
金风科技	29		0.00%	0.01%		
持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例前五名	30	(7)			≤16%	≤20%
其中：	31					
华宝添益 A	32-36		0.00%	0.00%		
融资(含融券)的金额/净资本	37	(8)	-	-	≤320%	≤400%
对单一客户融资(含融券)业务规模与净资本的比例前五名	38-44	(8)	-	-	≤4%	≤5%
接受单只担保股票市值与该股票总市值比例前五名	45-51	(9)	-	-	≤16%	≤20%

企业负责人:

财务负责人:

会计机构负责人:

北京高华证券有限责任公司

专项合并报表编制基础说明
2016 年 12 月 31 日
(金额单位：人民币元)

本 2016 年 12 月 31 日专项合并资产负债表、2016 年度专项合并利润表(以下合称“专项合并财务报表”)、2016 年 12 月 31 日专项合并净资本计算表、专项合并风险资本准备计算表及专项合并风险控制指标监管报表(以下合称“专项合并风险控制指标监管报表”)系按照中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)机构部部函[2009]552 号《关于明确证券公司分类评价工作中有关事项的函》(以下简称“552 号文”)及中国证监会机构监管部和会计部联合制定的《证券公司年报监管工作指引第 1 号—基本工作要点》(以下简称“指引”)的相关规定编制。

依据 552 号文的相关要求，证券公司控股的证券子公司原则上应合并纳入母公司分类评价。因此，北京高华证券有限责任公司(以下简称“本公司”)的证券子公司高盛高华证券有限责任公司(以下简称“高盛高华”)将合并纳入本公司分类评价。同时依据 552 号文要求，母公司合并评价所需向中国证监会呈报的专项合并报表的合并范围为参与合并评价的母子公司，包括财务报表(资产负债表、利润表)、净资本计算表、风险资本准备计算表及风险控制指标监管报表。

依据指引的相关要求，本公司需要编制 2016 年度专项合并财务报表、2016 年 12 月 31 日专项合并风险控制指标监管报表。截至 2016 年 12 月 31 日本公司仅有高盛高华一家证券子公司。上述专项合并风险控制指标监管报表为根据中国证监会《关于修改〈证券公司风险控制指标管理办法〉的决定》(证监会令第 125 号)、《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告[2016]10 号)和《关于证券公司风险控制指标监管报表填报有关事项的通知》(机构部函[2016]2489 号)的规定编制。

北京高华证券有限责任公司

专项合并风险控制指标监管报表附注
2016 年 12 月 31 日
(金额单位：人民币元)

(1) 预警标准

预警标准为根据证监会发布的《证券公司风险控制指标管理办法》第二十一条，对各项风险指标设置的预警标准，对于规定“不得低于”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准(即监管指标)的 120%；对于规定“不得超过”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准(即监管标准)的 80%。

(2) 监管标准

监管标准为根据证监会发布的《证券公司风险控制指标管理办法》第十六条至第十七条，对各项风险指标设置的规定标准。

(3) 负债

根据证监会发布的《证券公司风险控制指标管理办法》中第三十六条，负债是指对外负债，不含代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、代理承销证券款。

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
合并负债总额	2,111,478,862.10	4,479,608,777.41
代理买卖证券款	(72,654,508.19)	(300,263,798.18)
合并对外负债总额	2,038,824,353.91	4,179,344,979.23

(4) 自营规模

	2016 年 12 月 31 日			2015 年 12 月 31 日		
	名义本金	计算标准	投资规模	名义本金	计算标准	投资规模
自营权益类证券及其衍生品			430,475,830.63			264,746,253.00
股票			374,791,631.74			231,381,004.83
权益类基金			325.89			418.17
股指期货	371,225,820.00	15%	55,683,873.00	222,432,200.00	15%	33,364,830.00
非自营权益类证券及其衍生品			30,003,601.04			329,708,154.40
债券			-			272,704,653.88
非权益类基金			3,601.04			3,500.52
利率互换	1,000,000,000.00	3%	30,000,000.00	1,900,000,000.00	3%	57,000,000.00

(5) 持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名的证券

		2016 年 12 月 31 日			2015 年 12 月 31 日		
证券代码	证券简称	成本	净资本	比例	成本	净资本	比例
601318	中国平安	9,944,751.21	3,918,119,242.26	0.25%	12,099,049.85	5,385,621,895.06	0.22%
601166	兴业银行	8,535,341.29	3,918,119,242.26	0.22%	2,434,780.89	5,385,621,895.06	0.05%
600036	招商银行	7,889,478.32	3,918,119,242.26	0.20%	2,598,176.25	5,385,621,895.06	0.05%
000001	平安银行	7,465,360.71	3,918,119,242.26	0.19%	1,485,795.14	5,385,621,895.06	0.03%
600519	贵州茅台	7,247,159.79	3,918,119,242.26	0.18%	1,357,789.62	5,385,621,895.06	0.03%

(6) 持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名的证券

		2016 年 12 月 31 日			2015 年 12 月 31 日		
证券代码	证券简称	持有市值	该证券总市值	比例	持有市值	该证券总市值	比例
601939	建设银行	4,234,931.20	52,189,497,376.64	0.01%	114,230.14	55,451,340,962.68	0.00%
000157	中联重科	2,236,440.32	28,492,700,244.56	0.01%	1,557,278.00	33,576,199,627.40	0.00%
600089	特变电工	2,171,734.84	29,612,688,329.18	0.01%	925,816.43	38,241,361,884.22	0.00%
600804	鹏博士	2,021,924.07	31,010,375,690.67	0.01%	290,403.96	33,218,770,042.28	0.00%
002202	金风科技	2,291,627.85	38,249,305,762.00	0.01%	363,135.86	50,946,912,818.00	0.00%

(7) 持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例前五名

		2016 年 12 月 31 日			2015 年 12 月 31 日		
证券代码	证券简称	持有份额	该证券总份额	比例	持有份额	该证券总份额	比例
511990	华宝添益 A	36.00	619,018,178.70	0.00%	35.00	1,274,393,900.85	0.00%

(8) 对客户融资/融券业务

截至 2016 年 12 月 31 日，本集团尚未开展对客户的融资/融券业务，所以相关比例不适用。

(9) 接受担保股票业务

截至 2016 年 12 月 31 日，本集团无接受担保的股票，所以相关比例不适用。