

资产负债表

单位:广州证券股份有限公司

日期:2016-12-31

会证01表

单位:元

资产	期末余额	年初余额	负债及所有者权益	期末余额	年初余额
资产			负 债:		
货币资金	9,654,302,995.70	13,314,353,923.77	短期借款	-	
其中: 库存现金	6,099,966,592.62	8,102,071,673.35	应付短期融资券		

结算备付金	1,606,009,661.94	2,693,702,401.89	拆入资金	500,000,000.00	
其中: 客户备付金	983,578,645.48	1,710,267,806.23	交易性金融负债	1,951,446,160.00	1,162,323,140.00
拆出资金	-		衍生金融负债	-	12,040,349.42
融出资金	3,283,292,337.96	3,921,805,213.08	卖出回购金融资产款	7,514,493,852.67	10,526,084,117.86
交易性金融资产	3,337,913,753.40	3,006,673,277.71	代理买卖证券款	6,710,073,765.86	9,423,540,763.87
衍生金融资产	75,928,943.87	-	代理承销证券款	-	
买入返售金融资产	9,966,255,339.59	1,729,896,764.66	应付职工薪酬	628,834,078.74	568,012,954.91
应收帐款	198,787,441.34	60,978,242.21	应交税费	112,843,877.11	174,694,832.02
内部清算	-	-	应付利息	369,296,747.78	130,135,766.22
内部往来	-	-	应付款项	295,953,553.15	118,331,383.76
应收利息	471,110,759.40	369,966,096.14	预计负债	510,000.00	-

可供出售金融资产	75,127,000.00	66,600,000.00	减: 库存股	-	
持有至到期投资	-	-	盈余公积	139,745,739.90	139,745,739.90
长期股权投资	60,304,838.80	55,880,250.00	一般风险准备	564,264,586.56	564,264,586.56
递延所得税资产	92,140,485.77	65,395,261.47	其他综合收益	149,356,640.68	697,385,974.77
其他资产	318,049,727.16	737,841,273.42	未分配利润	1,208,151,662.65	727,831,165.33
货币兑换	-	-	营运资金	-	
待转承销费用	-	-	外币报表折算差额	-	
	-	-	所有者权益(或股东权益)合计	11,107,203,096.91	11,174,911,933.68
	-	-		-	
资产总计	40,456,114,351.37	40,500,670,237.41	负债及所有者权益总计		

证券公司净资本计算表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016年12月31日

单位：元

净资产	1	11,154,999,870.53	11,107,203,060.91		11,154,998,870.53	11,107,203,060.91
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	2,057,838,125.96	2,065,915,850.83		1,899,949,726.58	1,907,315,560.41
	4	247,454,476.68	251,567,360.8		89,566,027.30	95,966,745.66
期货保证金注1	6	89,566,027.30	95,966,745.66	100%	89,566,027.30	95,966,745.66
其他存出保证金	7				-	-
长期股权投资	8	1,522,180,528.30	1,526,829,041.96	100%	1,522,180,528.30	1,526,829,041.96
投资性房地产、固定资产注2	9	74,766,131.98	75,127,088.06	100%	74,766,131.98	75,127,088.06
其他注3	10	213,437,030.00	209,307,684.73	100%	213,437,030.00	209,307,684.73
减：或有负债的风险调整合计	11					
或有负债注4	12					
其他或有负债注5	13			100%	-	-
加：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计注6	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注6	17					
配发和回购证券业务的保证金（按监管注）	18					

证券公司风险资本准备计算表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016年12月31日

单位：元

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准	风险资本准备	
					期初余额	期末余额
1. 市场风险资本准备	1	16,079,829,093.87	14,353,796,912.34		2,684,488,110.86	2,402,362,868.46
其中：(1) 权益类证券及其衍生品规模注1	2	2,387,160,088.10	1,864,271,913.33		718,616,862.36	579,616,773.31
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	3	131,138,211.78	131,138,211.78	150%	19,670,085.27	19,670,085.27
买入股票成本	4	2,087,368,010.02	1,751,499,271.06	30%	626,210,403.01	525,449,781.32
流通受限的股票注2	5	118,469,927.57	106,255,986.65	50%	59,234,963.79	53,127,993.33
其他股票注3	6	-	-	80%	-	-
权益类基金注4	7	2,625,938,054.44	2,315,352,470.00	10%	843,408.04	495,336.00
其中：分级基金中的优先级份额	8	40,399,800.00	-	30%	12,119,940.00	-
股指期货、权证互换及类似权利注5	9	1,014,007.55	1,272,331.00	20%	202,801.51	254,466.20
买入期权注6	10	334,360.74	289,000.00	100%	334,360.74	289,000.00
其他	11	-	-	-	-	-
(2) 非权益类证券及其衍生品规模注1	12	13,692,669,005.77	12,489,524,999.01		1,965,871,248.50	1,822,746,000.00
国债、中央银行票据、国开债	13	1,608,334,621.00	1,954,824,340.00	0%	-	-
政策性金融债、政府支持机构债券注7	14	621,475,860.00	437,551,070.00	2%	12,429,517.20	8,751,024.40
地方政府债注8	15	1,777,170,851,000.00	1,391,098,690.00	5%	88,555,925.50	69,554,930.00
信用评级AA级以下的信用债券注9	16	1,114,113,317.88	1,007,463,301.07	10%	111,411,331.79	100,746,330.11
信用评级AAA级以下、AA级（含）以上的信用债券注9	17	5,763,078,629.64	5,221,934,445.26	15%	864,461,794.44	783,290,166.79
信用评级AA级以下、BBB级（含）以上的信用债券注9	18	55,050,535.00	5,084,115.00	50%	27,525,267.50	2,542,057.50
信用评级BBB级以下的信用债券注5	19	40,000,000.00	110,000,000.00	80%	32,000,000.00	88,000,000.00
非权益类基金注6	20	-	-	10%	-	-
其中：货币基金	21	457,469,585.48	8,397,819.87	5%	22,873,479.27	419,890.99
国债期货、利率互换及利率衍生品注10	22	1,064,593,505.00	1,469,158,982.50	20%	212,918,701.00	293,831,796.50
贵金属及贵金属衍生品注11	23	254,146,082.00	215,219,790.17	-	165,783,041.00	100,853,820.09
其中：未约定平仓承担亏损	24	27,160,000.00	22,000,000.00	25%	6,756,075.00	5,575,000.00
约定平仓承担亏损	25	317,986,082.00	188,195,490.17	50%	158,993,041.00	94,097,745.09
大宗商品注12	26	855,639,508.27	758,325,091.41	50%	132,814,351.00	119,797,647.76
大宗商品现货（含黄金）	27	-	-	8%	-	-
大宗商品衍生品注14	28	487,182.00	317,151.00	20%	97,436.40	63,430.20
其他	29	-	-	-	-	-
(3) 已对冲风险的权益类证券及其衍生品注7	30	-	-	-	-	-
权益类证券	31	-	-	5%	-	-
权益类衍生品注15	32	-	-	5%	-	-
(4) 已对冲风险的非权益类证券及其衍生品注7	33	-	-	-	-	-
非权益类证券	34	-	-	1%	-	-
非权益类衍生品	35	-	-	1%	-	-
2. 信用风险资本准备	36	13,381,059,101.62	13,723,046,828.11		1,987,718.76	2,040,021,880.46
融资类业务注8	37	10,733,493,791.39	10,789,676,336.03		506,836.69	1,829,296,303.10
其中：融资融券业务注8	38	3,671,922,715.95	3,286,589,641.04	10%	367,192,271.60	328,638,964.10
其中：股票质押回购	39	7,061,571,075.44	7,503,286,694.99	20%	1,412,314,215.09	1,500,657,339.00
场外融资业务	40	-	-	30%	-	-
应收账款	41	396,683,204.20	466,648,020.48	-	179,061,871.01	186,068,058.62
其中：账龄一年以内（含）应收账款注16	42	241,801,481.32	311,766,297.60	10%	24,180,148.13	31,176,629.76

证券公司风险控制指标监管报表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016 年 12 月 31 日

单位：元

项 目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
核心净资本	1	9,255,039,152.94	9,199,887,536.50			-0.60%
附属净资本	2	3,220,117,267.80	3,070,117,267.80			-4.66%
净资本	3	12,475,156,420.74	12,270,004,804.30			-1.64%
净资产	4	11,154,988,879.52	11,107,203,096.91			-0.43%
各项风险资本准备之和	5	5,466,161,392.59	5,594,494,680.73			2.35%
表内外资产总额	6	35,629,873,665.38	35,677,811,345.58			0.13%

净资本与净资产的比例	7	110.85%	110.47%	≥100%	≥100%	达标
净资本与负债的比例	8	151.12%	156.18%	≥150%	≥150%	达标
净资本与风险资本准备的比例	9	228.24%	219.32%	≥200%	≥200%	达标
流动资产与负债的比例	10	111.85%	110.47%	≥100%	≥100%	达标
净资本与表内外资产总额的比例	11	34.72%	34.40%	≥24%	≥20%	达标
净资本与受托资产总额的比例	12	54.34%	54.20%	≥29.6%	≥28%	达标
净资本与受托客户保证金的比例	13	48.59%	49.06%	≥12%	≥10%	达标
自有资金与自有资金运用总额的比例	14	19.14%	15.19%	≥80%	≥100%	200.0%

附注

1. 净资本与净资产的比例

2.

3.

4.

5.

6.

7.

8.

9.

10.

11.

12.

13.

14.

15.

位：元	
果	
14,51.37	
73,65.86	
073,755.86	
833,726.65	
240,759.21	
40,55.51	
037,41.50	
158,98.50	
272,33.00	
317,15.00	
-	
289,90.00	
733,29.57	
-	
-	
-	
-	
-	
-	
70,760.07	
11,345.58	

3/27

复利