



天风证券股份有限公司
2015年度报告及审计报告

二〇一六年

湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

电话：027-87618867 传真：027-87618863

目录

一、2015 年度报告.....	1
二、审计报告.....	79
三、净资本审核报告.....	175
四、内部控制鉴证报告.....	191
五、客户资金安全审核报告.....	221
六、客户资产管理业务审核报告(一).....	235
七、客户资产管理业务审核报告(二).....	249



天风证券股份有限公司

年度报告

(二〇一五年度)



二〇一六年

第一章 重要提示、目录和释义

本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证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，并就其承担个别和连带的法律责任。

未有董事、监事、高级管理人员声称对年度报告内容的真实性、准确性和完整性无法保证或存在异议。

公司董事长余磊先生，主管会计工作负责人张军先生及会计机构负责人冯琳女士声明：保证年度报告中财务报表的真实、准确、完整。

大信会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

余磊 张军
冯琳 谈琳

目 录

第一章	重要提示、目录和释义	3
第二章	公司概况	6
第三章	管理层报告	20
第四章	股本变动及股东情况	40
第五章	董事、监事、高级管理人员和员工情况	45
第六章	公司治理	62
第七章	内部控制	76
第八章	财务报告	78

释 义

报告期	指	2015 年
元/万/亿	指	人民币元/万元/亿元, 文中另指除外
天风证券/天风/本公司/公司	指	天风证券股份有限公司
天风有限	指	发行人前身, 包括成立于 2000 年 3 月 29 日的四川省天风证券经纪有限责任公司, 2003 年 8 月更名为四川省天风证券有限责任公司, 2004 年 4 月更名为天风证券有限责任公司, 2006 年 11 月更名为天风证券经纪有限责任公司, 2009 年 9 月更名为天风证券有限责任公司
会计师/审计机构/大信	指	大信会计师事务所(特殊普通合伙)
A 股	指	在中国境内证券交易所上市、以人民币标明股票面值、以人民币认购和进行交易的普通股
上市/IPO	指	首次公开发行股票并在证券交易所挂牌交易
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
湖北证监局	指	中国证券监督管理委员会湖北监管局
武汉国资	指	武汉国有资产经营公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
人福医药	指	人福医药集团股份公司(曾用名“武汉人福高科技产业股份有限公司”), 截至报告期末公司 47 家股东之一
湖北省联发	指	湖北省联合发展投资集团有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
陕西大德	指	陕西大德投资集团有限责任公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
宁波信达	指	宁波信达天赢投资合伙企业(有限合伙), 截至报告期末公司 47 家股东之一
中航信托	指	中航信托股份有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
苏州建丰	指	苏州建丰九鼎投资中心(有限合伙), 截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉高科	指	武汉高科国有控股集团有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
当代科技	指	武汉当代科技产业集团股份有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
恒健通	指	武汉恒健通科技有限责任公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
湖北省科投	指	湖北省科技投资集团有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
银海置业	指	武汉银海置业有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
上海天闾	指	上海天闾投资合伙企业(有限合伙), 截至报告期末公司 47 家股东之一
融鼎富	指	北京融鼎富投资管理有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一
上海潞安	指	上海潞安投资有限公司, 截至报告期末公司 47 家股东之一

上海天涵	指	上海天涵投资管理合伙企业（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
仁军投资	指	武汉市仁军投资咨询有限责任公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
光大金控	指	宁波光大金控财智汇通股权投资中心（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
四川华西	指	四川华西集团有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
上海天霏	指	上海天霏投资合伙企业（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉铁源	指	武汉市铁源物资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
苏州湾流	指	苏州湾流重明投资中心（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
富沃投资	指	富沃投资（江苏）有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
麦肯特	指	深圳麦肯特中南投资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
成都奎星	指	成都奎星物流有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉新洪	指	武汉新洪农工商有限责任公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
道博股份	指	武汉道博股份有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉奥兴	指	武汉奥兴高科技开发有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
嘉兴元泽	指	嘉兴元泽投资中心（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
鄂西投资	指	湖北省鄂西生态文化旅游圈投资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
宁波厚泽	指	宁波厚泽顺势股权投资合伙企业（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
上海广承	指	上海广承投资管理中心（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
三特索道	指	武汉三特索道集团股份有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉恒泰	指	武汉恒泰睿风投资合伙企业（有限合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
光谷投资担保	指	武汉光谷投资担保有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
银丰棉花	指	湖北银丰棉花股份有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
九天广告	指	广东九天影视广告有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
上海和生	指	上海和生投资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
四川创美	指	四川创美实业有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉瀛孚	指	武汉瀛孚投资管理中心（普通合伙），截至报告期末公司 47 家股东之一
京山轻机	指	湖北京山轻工机械股份有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
上海鼎石	指	上海鼎石投资管理有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一

新金投资	指	武汉新金投资管理有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
荆州古城国投	指	荆州市古城国有投资有限责任公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
武汉融景	指	武汉融景科技投资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
中灏投资	指	武汉中灏投资有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
光兴投资	指	武汉光兴投资管理有限公司，截至报告期末公司 47 家股东之一
科信小贷	指	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司
宜宾商行	指	宜宾市商业银行股份有限公司
天风天盈	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风天盈投资有限公司
天风天睿	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风天睿投资有限公司
天风期货	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风期货有限公司，2015 年 5 月股份制改制后更名为天风期货股份有限公司
天风创新	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风创新投资股份有限公司
武汉股权交易中心	指	武汉股权托管交易中心有限公司
睿信资本	指	天风天睿控股子公司，睿信资本（武汉）投资管理有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《天风证券股份有限公司公司章程》，在上市前公司现行有效的公司章程
《公司章程(草案)》	指	经本公司2015年第八次临时股东大会审议通过的《天风证券股份有限公司章程（草案）》，待中国证监会核准本次发行后于本公司股票上市之日起生效

重大风险提示

公司已在本报告中详细描述公司存在的风险因素，敬请查阅本报告第三章“六、公司经营活动中可能面临的风险和应对措施”部分的内容。

第二章 公司概况

一、公司简介:

1、公司名称

公司法定中文名称: 天风证券股份有限公司

公司法定中文简称: 天风证券

公司法定英文名称: Tianfeng Securities Co.,Ltd

公司法定英文简称: TF SECURITIES

2、法定代表人: 余磊

董 事 长: 余磊

总 裁: 张军

3、报告期内公司注册资本、净资本和各单项业务资格

注册资本: 4,662,000,000 元

净 资 本: 7,872,839,254 元

各单项业务资格

(1) 证券经纪业务资格

(2) 证券投资咨询业务资格

(3) 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问业务资格

(4) 证券投资基金代销业务资格

(5) 证券承销与保荐业务资格

(6) 证券自营业务资格

(7) 证券资产管理业务资格

(8) 融资融券业务资格

(9) 代销金融产品业务资格

(10) 为期货公司提供中间介绍业务资格

4、公司通讯方式

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

邮政编码： 430024

互联网址： www.tfzq.com

电子信箱： dongban@tfzq.com

5、董事会秘书

姓 名： 黄其龙

联系地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

电 话：（027）87618876

传 真：（027）87618863

电子信箱： huangqilong@tfzq.com

二、公司历史沿革

1、公司整体变更情况

本公司系由天风有限整体变更设立。天风有限前身为四川省天风证券经纪有限责任公司。1999 年 7 月 27 日，四川省人民政府出具《关于成都联合期货交易所改组为四川省天风证券经纪有限责任公司的函》（川府函【1999】150 号），根据证监会《关于成都联合期货交易所改组方案的批复》（证监期字【1998】年 24 号）精神，向证监会申请将原成都联合期货交易所改组为四川省天风证券经纪有限责任公

司。1999年10月25日，证监会出具《关于同意原成都联合期货交易所改组及筹建证券经纪公司方案的批复》（证监机构字【1999】119号），同意四川省人民政府的申请。2000年3月17日，证监会出具《关于同意四川省天风证券经纪有限责任公司及成都走马街证券营业部开业的批复》（证监机构字【2000】55号），同意公司开业。

2003年6月4日，证监会以《关于同意四川省天风证券经纪有限责任公司增资扩股的批复》（证监机构字【2003】117号）同意公司更名为“四川省天风证券有限责任公司”；2006年10月20日，证监会以《关于天风证券有限责任公司减少注册资本、修改章程以及变更名称的批复》（证监机构字【2006】245号）同意公司更名为“天风证券经纪有限责任公司”；2009年8月17日，证监会以《关于核准天风证券经纪有限责任公司变更公司章程重要条款的批复》（证监许可【2009】801号）同意公司更名为“天风证券有限责任公司”。

2011年10月14日，公司2011年第三次临时股东会审议通过了公司整体变更为天风证券股份有限公司的方案。2011年12月22日，公司2011年第四次临时股东会审议调整了公司整体变更为股份有限公司的方案。2012年1月20日，证监会出具《关于核准天风证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》（证监许可【2012】96号），核准公司变更为股份有限公司，变更后公司名称为“天风证券股份有限公司”，注册资本为837,000,000元。2012年2月23日，公司在武汉市工商行政管理局东湖分局完成工商登记手续，并获得新的营业执照。

2、公司以前年度改制重组、股本变动情况

2000年3月，根据国务院关于进一步整顿期货市场、合并缩减国内期货交易所的精神，经中国证监会批准，成都联合期货交易所改组为四川省天风证券经纪有限责任公司，公司股东为5家，注册资本为77,000,000元。

2002年12月10日，四川省天风证券经纪有限责任公司股东会通过关于增资扩股的议案。2003年6月4日，经中国证监会《关于同意四川省天风证券经纪有限责任公司增资扩股的批复》（证监机构字【2003】117号）和2003年9月4日《关于四川省天风证券经纪有限公司调整增资扩股方案有关问题的函》（证监机构字【2003】124号）批准四川省天风证券经纪有限责任公司增资扩股、比照综合类证券公司经营。2003年9月，公司完成增资扩股工商变更登记，股东由5家增至15家，注册资本增加到548,760,000元。

2005年3月10日，天风证券有限责任公司通过了2004年度股东会减资议案。2006年10月20日，中国证监会《关于天风证券有限责任公司减少注册资本、修改公司章程及变更名称的批复》（证监机构字【2006】245号）批准公司减少注册资本及公司名称变更。2006年11月，公司完成工商变更登记，股东由15家减至7家，注册资本减少到181,000,000元。

2008年5月26日，天风证券经纪有限责任公司通过了2008年第一次临时股东会关于增资扩股的议案。2009年2月25日，中国证监会《关于核准天风证券有限责任公司变更注册资本的批复》（证监许可【2009】179号）批准了公司增资扩股申请。2009年4月8日，公司完成了工商变更登记手续，股东由7家增加为8家，注册资本增加至315,000,000元。

2009年12月11日，天风证券有限责任公司通过了公司股东股权转让的议案。2010年4月29日，中国证监会湖北监管局出具了《关于天风证券有限责任公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》（鄂证监函【2010】65号）。2010年6月1日，中国证监会《关于核准天风证券有限责任公司变更持有5%以上股权的股东的批复》（证监许可【2010】749号）同意了公司股权变更的申请。2010年6月21日，公

司完成工商变更登记手续，公司股东由 8 家变更为 12 家。

2010 年 11 月 8 日，天风证券有限责任公司通过了 2010 年第一次临时股东会将公司的注册资本由 315,000,000 元变更为 837,000,000 元的议案。2011 年 1 月 11 日，中国证监会《关于核准天风证券有限责任公司变更注册资本的批复》（证监许可【2011】55 号）核准了公司关于变更注册资本的申请，同意公司增资扩股方案。2011 年 2 月 22 日，公司完成工商变更登记，股东由 12 家增至 17 家，注册资变更为 837,000,000 元。

2012 年 3 月 31 日，天风证券股份有限公司通过了 2012 年第三次临时股东大会《关于公司增资扩股方案的议案》。2012 年 5 月 18 日，湖北证监局《关于核准天风证券股份有限公司变更注册资本的批复》（鄂证监机构字【2012】41 号）核准了公司关于变更注册资本的申请，同意公司增资扩股方案。2012 年 6 月 18 日，公司完成了工商变更登记，股东由 17 家变更为 20 家，注册资本增至 1,570,000,000 元。

2013 年 4 月 22 日，天风证券股份有限公司通过了 2012 年年度股东大会《公司 2012 年度利润分配方案的议案》，会议决议以 2012 年 12 月 31 日的未分配利润向全体股东每 1000 股送红股 9 股，共计派发股票股利人民币 14,130,000 元。同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 1 股，共计转增 15,700 万股。实施完成后，天风证券总股本将增加至 1,741,130,000 股，注册资本将增加至人民币 1,741,130,000 元。2013 年 7 月 24 日，中国证监会《关于核准天风证券股份有限公司变更注册资本的批复》（证监许可【2013】969 号）核准了公司关于变更注册资本的申请。2013 年 9 月 16 日，公司完成了工商变更登记，股东为 20 家，注册资本变更为 1,741,130,000 元。

2014 年 4 月 25 日，天风证券召开 2013 年年度股东大会会议，审议通过将公司的注册资本由 1,741,130,000 元增加至 2,341,130,000

元。2014年7月22日，中国证监会湖北监管局出具《关于接收天风证券股份有限公司增加注册资本且股权结构未发生重大调整备案文件的回执》，接收了对前述增资事宜的备案。2014年7月9日，公司完成了工商变更登记，股东为20家，注册资本变更为2,341,130,000元。

2015年3月2日，天风证券召开2015年第三次临时股东大会会议，审议通过将公司的注册资本由2,341,130,000元增加至4,662,000,000元，股东为47家。2015年6月30日，中国证监会湖北监管局出具《关于接收天风证券股份有限公司增加注册资本且股权结构未发生重大调整备案文件的回执》，对前述增资事宜进行备案。公司于2015年6月16日完成工商登记变更，股东为47家，注册资本变更为4,662,000,000元。

三、公司组织结构

1、公司机构

天风证券遵循《公司法》《证券法》《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》《证券公司内部控制指引》及《公司章程》等有关规定，构建规范、科学、有效的法人治理结构，并根据公司发展需要不断调整组织架构和运行机制。

公司最高权力机构为股东大会；决策机构为董事会，对股东大会负责；董事会下设发展战略委员会、薪酬与提名委员会、审计委员会、风险管理委员会四个专门委员会，各专门委员会对董事会负责；监督机构为监事会，对股东大会负责。

报告期内，公司各部门及其主要职能分别是：

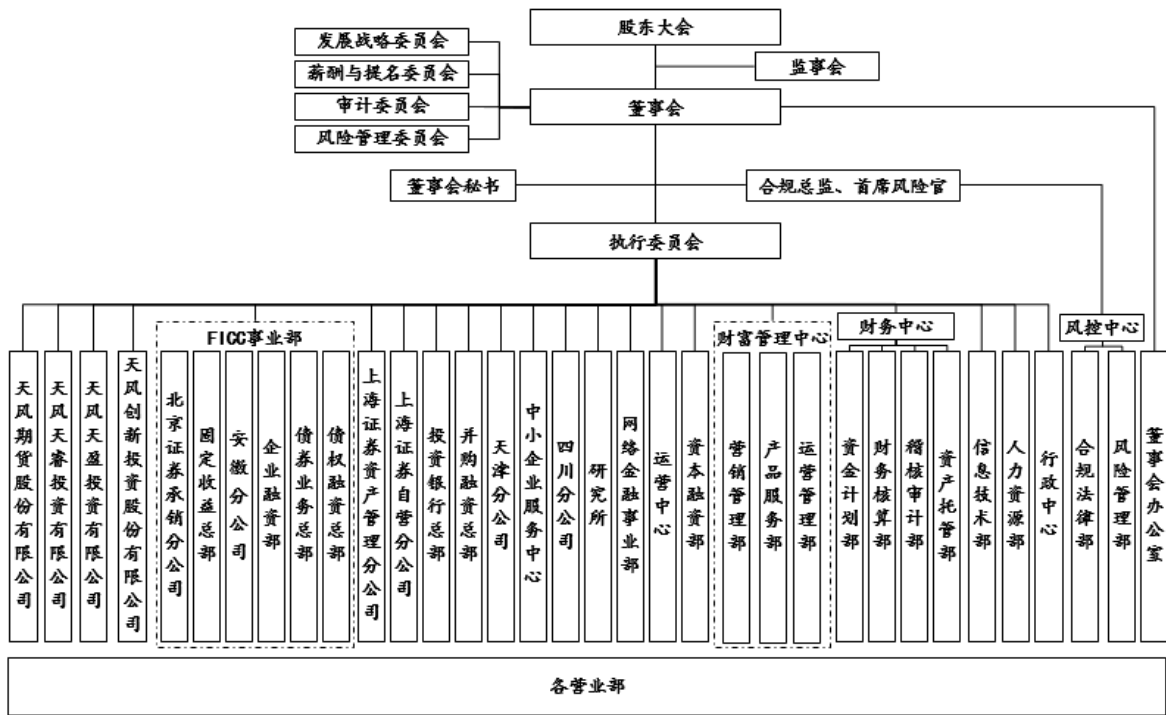
序号	部门	主要职能
1	投资银行 总部	组织开展各项投资银行业务，完成公司下达的经营目标和业务发展目标；综合开发与有效配置公司投资银行业务资源；防范投资

		银行业务过程风险，监督、控制业务质量。
2	中小企业服务中心	按照国家有关法律、法规和公司的相关管理办法，为中小企业客户提供综合金融服务，组织开展新三板推荐、财务顾问、并购重组和做市交易等业务。
3	固定收益总部	负责公司所承销固定收益类证券的销售和兑付，组建债券销售渠道和投资人网络，建立客户资源，进行债券的销售与交易业务。
4	并购融资总部	开展和管理并购重组、企业融资业务的开发承揽、方案设计及运作，评估项目风险和公司风险，并采取措施有效防范；掌握和分析国内外业务动态，及时制定和调整业务策略、研究业务发展模式。
5	企业融资部	按照国家有关法律、法规和公司的相关管理办法，在区域市场开展企业债的项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作，为区域内机构客户提供综合金融投融资服务。
6	债券业务总部	按照国家有关法律、法规和公司的相关管理办法，在区域市场开展债券类项目的承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作，为区域内机构客户提供综合金融投融资服务。
7	债权融资总部	按照国家有关法律、法规和公司的相关管理办法，制定债权融资业务规划，为目标企业提供债权类融资业务专项服务及相关客户关系维护，开展债券类产品的销售工作。
8	研究所	依据公司战略规划和业务发展，进行宏观策略研究、行业研究、公司研究、金融工程研究和专项调研，为公司各业务部门和外部机构投资者提供研究咨询服务。制订研究所各项管理制度，建立研究报告质量审核、研究报告发布和管理考核制度，明确研究所工作流程，保障研究工作顺利进行。
9	网络金融事业部	建立网络金融产品研究、生产、营销服务体系，满足客户投融资在线服务需要。通过互联网技术，建设网络金融研究、生产、营销和服务平台，构建互联网券商运营框架。通过线上线下结合，营销推广并提供互联网综合金融服务。
10	运营中心	根据公司有关制度的规定拟订和完善客户选择标准、客户征信、客户资格审查和授信管理等制度及业务操作流程，组织开展信用业务、期权业务宣传和投资者教育培训，对证券营业部业务操作进行审批、复核、监督及其他业务指导支持，对信用业务、期权业务客户进行资质审核、征信调查和信用评级管理，制订信用业务、期权业务合同的标准文本，拟订和完善客户信用及期权账户的相应变动对应制度和流程，负责信用业务、期权业务客户合同签订、账户开销户管理和业务档案管理，对信用业务、期权业务资产进行风险控制。建立客户资料及信用档案，进行数据统计、分析、信息披露，受理客户对账异常等反馈信息。负责与机构间私募产品报价与服务系统（简称：报价系统）的业务对接工作，目前我公司在报价系统主要开展的有收益凭证及股权众筹业务，运营中心主要负责产品注册、系统参数设置、营业部客户管理、数据统计、资料保管等工作。
11	资本融资部	按照国家有关法律、法规和公司的相关管理办法，以信托业务与资产管理业务为依托，兼顾开展资产证券化与债券业务，同时通

		过经纪业务与直销团队，提供高效、多层次的金融服务。
12	营销管理部	确保公司经纪业务任务的完成与增长，保障公司营销队伍建设及相关培训，设立业务部门及营业网点考核指标，并对其业务情况督导及考核。开展公司品牌建设，策划及推广公司营销活动，管理及规划各条营销渠道。开展高净值客户的财务顾问业务。
13	产品服务部	研究、计划、组织、开发贴近客户需求的金融产品，建立品种齐全、风险覆盖范围广的金融产品线。建立数据资料库，整合与协调各部门的研发资源，制作各类资讯产品，对公司的投顾业务进行整体规划、综合管理和后台支持，协调各项资源。建立有竞争力的客户服务模式，对产品及投顾业务平台进行综合规划，促使业务管理规范、快捷、清晰可见，同时对电子商务模式进行研究开发。
14	运营管理部	协调总部各职能部门共同对营业部日常经营提供后台支持，督导营业部开展业务符合法律法规监管要求，协助零售条线整合资源共同推进零售业务增长和发展。管理交易所、结算公司开展的业务，履行对柜台系统中的权限、账户、交易、资金等业务的运营管理和后台支持职能，保障营业部客户业务正常受理和办理。管理公司发行和代销的各类金融产品的认购、申购、赎回后台业务维护、信息公告，为客户提供综合金融理财服务。保持与证监会及下属证监局、证券业协会、人民银行等机构的有效沟通，保障证券零售业务和营业部各项经营活动符合法律、法规的监督管理要求，落实监管报送、报告工作。协调与期货公司的合作，有效落实期货 IB 业务的合法合规、有序开展，配合期货公司为天风证券开展证券 IB 业务，实现证券和期货的合作共赢。管理公司经纪人业务的合法、合规开展，维护和提升 CRM 系统的应用效果，为营业部营销管理和客户服务做好基础平台。
15	资金计划部	负责公司资金管理制度、资金计划与日常调度；根据公司经营目标安排资金使用计划，提交自有资金使用方案；总管资金使用的审核、监督，进行预算及费用控制。
16	财务核算部	制订会计核算制度，办理会计核算，负责会计档案的保管、立卷、归档、整理等工作；负责公司财务报表的汇总和审核，对营业部、分公司的财务会计工作进行指导，上报财务报表；负责对公司财务情况进行定期分析，编写分析报告、财务年度决算报告。
17	稽核审计部	对会计日常核算的合法合规性进行不定期的审核，提出建议；对集团及各子公司、营业部等审计；根据公司要求开展专项审计，评价审计事项的适当性和有效性，并提出改进建议；根据证券公司内部控制指引以及国内外内部控制管治要求，建立符合上市要求的内部监控体系。
18	资产托管部	私募基金托管的专职部门，履行私募基金的托管人职责。负责私募基金资产的保管、估值、清算，与管理人核对基金资产净值，执行基金管理人的投资指令，并监督基金管理人的投资运作。
19	信息技术部	按照证券行业信息系统技术规范要求，根据本公司业务发展情况制定公司信息系统建设总体规划，建立健全规章制度；制定公司计算机设备、系统软件的采购计划，组织项目验收；负责公司集

		中交易系统、法人清算系统、财务系统以及其他应用系统的运行、管理、维护。
20	人力资源部	依据公司的战略规划,组织和制定公司人力资源发展规划并执行,制订和修订公司人力资源发展政策和各项相关管理制度,配合公司人力资源发展的战略目标,制订公司整体的年度人力资源需求以及相应的执行计划,指导和监督公司各部门和分支机构执行落实。负责公司人才开发、招聘、选拔体系的建设和人员优化配置工作,统筹构建岗位素质模型和公司员工职业发展生涯体系,持续完善公司多序列职业发展通道,负责人力资源分析、劳动关系、薪酬福利、绩效管理、人力资源信息化和其他各项人力资源业务,确保对公司发展的专业服务和支持,指导和协助分公司/营业部的人力资源管理工作,及时提供相应专业支持,负责向公司职员提供专业咨询和相关培训,帮助建立正确的人力资源管理观念与技能。指导协助控股公司、参股公司开展人力资源管理工作,提供专业支持。
21	行政中心	依据公司的战略规划,组织和制定公司行政管理发展规划,并负责督导及贯彻执行,及时宣传、沟通,确保相关规划的有序开展。承担公司大中型会务筹办与接待、房产筹建与物业管理、装修改造与审计、消防安全以及车辆管理工作。组织安排党务、工会和团员活动。严格按照公司各类行政管理规定,做好日常行政事务管理工作,保证公司日常经营活动的正常运转,为公司提供优质的后勤服务。
22	合规法律部	为公司内部管理制度和业务规则的合规性把关并监督执行。对公司重大决策和主要业务活动进行合规审核。对公司的合规状况以及内部控制的有效性进行监测和检查,及时发现违法违规行为,按照职责分工和程序进行查处或移交处理,并按规定报告。
23	风险管理部	根据公司风险偏好和战略制定风险策略。制定、执行风险管治模式。制定风险管理制度和操作规程。定义风险控制和流程、监测控制有效性和剩余风险、监测正在应用的方法的有效性、监控风险管理 IT 系统。监控公司净资本等各项风险控制指标及其变化。
24	董事会 办公室	负责协助董事会执行公司治理、信息披露、投资者关系管理等相关工作,承担各项与董事会相关的综合行政职能,拟订和完善公司治理结构层面的有关规章制度负责公司信息披露事务,保管公司股东名册,管理公司股权。处理公司信息的对外发布并组织或参与各类宣传活动,提升公司形象。

公司组织机构图如下



2、报告期内公司境内子公司情况

(1) 天风期货股份有限公司

公司注册地址：大连市沙河口区中山路478-1-3

公司办公地址：大连市沙河口区中山路478号华邦上都A座3楼

设立时间：1996年3月29日

注册资本：16,000万元人民币

法定代表人：孙坤

联系电话：0411-39779976

(2) 天风天盈投资有限公司

公司注册地址：湖北省武汉市东湖开发区关东科技工业园华光大道18号高科大厦3层

公司办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座48楼

设立时间：2012年3月8日

注册资本：25,000 万元人民币

法定代表人：刘翔

联系电话：027-87618897

(3) 天风天睿投资有限公司

公司注册地址：湖北省武汉市东湖开发区关东科技工业园华光大道18号高科大厦4层01室

公司办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座48楼

设立时间：2013年4月22日

注册资本：88,200 万元人民币

法定代表人：黄其龙

联系电话：027-87618876

(4) 天风创新投资股份有限公司

公司注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢4楼433室

公司办公地址：北京市西城区佟麟阁路36号

设立时间：2015年12月14日

注册资本：10,000 万元人民币

法定代表人：王琳晶

联系电话：010-59833033

3、公司境内分公司情况

(1) 天风证券股份有限公司北京证券承销分公司

公司营业场所：北京市西城区佟麟阁路36号1幢1201-1230室

设立时间：2011年11月2日

公司负责人：王琳晶

联系电话：010-65522700

(2) 天风证券股份有限公司上海证券资产管理分公司

公司营业场所：上海市浦东新区芳甸路1088号2011单元

设立时间：2011年11月2日

公司负责人：许欣

联系电话：021-50155260

(3) 天风证券股份有限公司上海证券自营分公司

公司营业场所：上海市浦东新区芳甸路1088号18层2单元

设立时间：2013年6月18日

公司负责人：伊川

联系电话：021-50769208

(4) 天风证券股份有限公司四川分公司

公司营业场所：成都市高新区天府大道北段966号天府国际金融中心2号楼2层20214-20221房间

设立时间：2012年11月7日

公司负责人：徐姝

联系电话：028-86604877

(5) 天风证券股份有限公司安徽分公司

公司营业场所：合肥市庐阳区阜南路169号东怡金融广场B座2906

设立时间：2014年9月3日

公司负责人：杨海彬

联系电话：0551-64663198

(6) 天风证券股份有限公司天津分公司

公司营业场所：天津市和平区小白楼街解放北路 158 号附楼 201

设立时间：2015 年 10 月 22 日

公司负责人：李育飞

联系电话：022-59061800

4、证券营业部

报告期内，公司正式营运的证券营业部 34 家，其中北京市 2 家，上海市 4 家，重庆市 1 家，湖北省 12 家，四川省 6 家，辽宁省 3 家，广东省 2 家，江苏省 1 家、浙江省 1 家，湖南省 1 家，安徽省 1 家。

序号	区域	证券营业部名称	地址
1	四川	成都市一环路东五段证券营业部	四川省成都市锦江区一环路东五段 8 号天府国际 15 层 03、04 单元
2		什邡蓥峰北路证券营业部	四川省什邡市方亭城区强华步行街 5、6 号
3		江油李白大道证券营业部	四川省江油市李白大道东侧宏安中华御景 1 栋 2 楼 1 号
4		新津武阳中路证券营业部	四川省新津县五津镇武阳中路 54 号 2 楼
5		资阳广场路证券营业部	四川省资阳市雁江区广场路 10 号茂林 28 城三楼
6		成都高华横街营业部	四川省成都市武侯区高华横街 33 号三楼 1 号
7	辽宁	大连天河路证券营业部	辽宁省大连市甘井子区 天河路 81 号
8		大连中山路证券营业部	辽宁省大连市沙河口区中山路 572 号星海旺座 2 层
9		大连普兰店体育路营业部	辽宁省大连普兰店体育路东段 11-9 号
10	广东	深圳滨河路营业部	广东省深圳市福田区滨河路车公庙泰然水松大厦 20 层
11		广州华夏路证券营业部	广东省广州市天河区华夏路 30 号 2706 房
12	江苏	南京建邺路证券营业部	江苏省南京市秦淮区建邺路 98 号

13	湖北	武汉八一路证券营业部	湖北省武汉市武昌八一路 87 号银海华庭 1 楼	
14		武汉唐家墩路证券营业部	湖北省武汉市江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座一楼	
15		武汉佳园路证券营业部	湖北省武汉市东湖新技术开发区佳园路 2 号高科大厦 3 楼	
16		襄阳长征路证券营业部	湖北省襄阳市樊城区长征路 60 号齐星泰安华府 1-3-4	
17		襄阳东风汽车大道证券营业部	湖北省襄阳市高新区阳光绿岛 D 幢 1 层 103 号	
18		钟祥王府大道证券营业部	湖北省钟祥市王府大道 32-5 号	
19		荆门军马场一路证券营业部	湖北省荆门市掇刀区军马场一路 2 号	
20		京山轻机大道证券营业部	湖北省京山县轻机大道 276 号	
21		天门钟惺大道证券营业部	湖北省天门市钟惺大道 36 号天下都市港湾 1 号楼	
22		谷城振兴街证券营业部	湖北省谷城县城关镇振兴街 110 号	
23		宜城自忠路证券营业部	湖北省宜城市鄢城自忠路	
24		宜昌夷陵大道证券营业部	湖北省宜昌市西陵区夷陵大道 98 号	
25		北京	北京佟麟阁路证券营业部	北京市西城区佟麟阁路 36 号 1 幢 1103-1105 室
26			北京海淀长春桥证券营业部	北京市海淀区长春桥路 11 号 1 号楼 6 层 605
27	上海	上海芳甸路证券营业部	上海市浦东区芳甸路 1088 号 12 层 01-06 单元	
28		上海国宾路证券营业部	上海市杨浦区国宾路 36 号 1109 室	
29		上海马当路证券营业部	上海市黄浦区淡水路 277 号 SOHO 复兴广场 503 室	
30		上海漕溪北路证券营业部	上海市徐汇区漕溪北路 88 号 2604、2605、2602 室	
31	重庆	重庆沧白路证券营业部	重庆市渝中区沧白路 73 号永众国际大厦 12 楼	
32	浙江	杭州教工路证券营业部	浙江省杭州市西湖区教工路 88 号立元大厦 12 层 1201 室	
33	湖南	长沙韶山中路证券营业部	湖南省长沙市雨花区韶山中路 419 号顺天国际金融中心 1428、1429 号	
34	安徽	合肥阜南路证券营业部	安徽省合肥市庐阳区阜南路 169 号东怡金融广场 B-2907 室	

第三章 管理层报告

一、公司盈利情况

表：2015年和2014年合并收支情况

单位：万元

项目	2015年度	2014年度	增加额	增长比例
一、营业收入	322,383.91	111,216.96	211,166.95	189.87%
手续费及佣金净收入	157,608.43	65,062.91	92,545.53	142.24%
其中：经纪业务手续费净收入	56,682.26	22,418.92	34,263.34	152.83%
投资银行业务手续费净收入	61,492.09	18,000.26	43,491.82	241.62%
受托客户资产管理业务净收入	16,458.03	4,476.09	11,981.94	267.69%
利息净收入	7,122.56	8,173.57	-1,051.01	-12.86%
投资收益	130,034.34	28,974.34	101,060.00	348.79%
公允价值变动收益	26,790.84	8,448.07	18,342.77	217.12%
汇兑收益	60.76	5.05	55.71	1102.28%
其他业务收入	766.98	553.02	213.96	38.69%
二、营业支出	194,176.78	83,318.87	110,857.91	133.05%
营业税金及附加	17,065.27	5,837.39	11,227.87	192.34%
业务及管理费	172,810.98	76,409.31	96,401.67	126.16%
资产减值损失	3,922.91	729.65	3,193.26	437.64%
其他业务成本	377.63	342.52	35.11	10.25%
三、营业利润	128,207.13	27,898.09	100,309.04	359.56%
加：营业外收入	800.53	296.09	504.44	170.37%
减：营业外支出	1,277.31	154.25	1,123.06	728.09%
四、利润总额	127,730.36	28,039.93	99,690.42	355.53%
减：所得税费用	27,612.92	6,429.71	21,183.21	329.46%
五、净利润	100,117.44	21,610.22	78,507.21	363.29%
归属于母公司所有者的利润	93,758.64	20,774.62	72,984.02	351.31%
少数股东损益	6,358.80	835.61	5,523.19	660.98%

2015年度，公司实现合并营业收入32.24亿，同比上涨189.87%，实现合并净利润10.01亿，同比上涨363.29%；母公司实现营业收入26.52亿，同比增长208.87%，实现净利润8.18亿，同比增长296.57%。公司在2015年持续发展各项业务卓有成效，盈利能力继续增强，各类新业务收入在总收入中所占比重不断加大，占有重要地位。

1、营业收入：2015年合并营业收入32.24亿，母公司营业收入26.52亿元。在经过前两年的飞速增长后，各项业务收入在2015年持续保持较

高增速。

(1) 经纪业务

2015年市场交易量较去年同期有大幅提升，公司各营业部的交易量也随之增加，并超越市场增加率，经纪业务收入相应增长。从证券交易情况来看，和2014年市场比，沪深交易额上涨279.58%；公司交易额高于市场增长率，上涨了363.32%，佣金率降低了37.76%，市占率增加22.06%。经纪业务市场竞争日趋激烈，公司的经纪业务客户基础相对较弱，为增加市场占有率，公司近年持续在扩大网点建设，继2013年新设6家营业部、2014年新设8家营业部后，2015年又新开网点7家。

(2) 自营业务

目前公司累计共投入47.30亿于自营业务。2015年，由于股债市场的行情向好，公司自营业务为盈利能力的增长做出了很大贡献。2015年，公司债券交易量持续呈现高位，在行业内保持前列。全年银行间累计交易量达到14,890.60亿，年度排名第9，日均撮合量为61.03亿，其中日均交易量最高（12月）为155.97亿。另外，公司2015年度在新三板做市方面持续表现突出，做市转让股票个数151支，行业排名第六。

(3) 大投行业务

2015年，公司在投行业务方面实现了营业收入6.15亿，与2014年的1.8亿相比，实现了超过两倍的增长。其中证券承销业务收入4.58亿，财务顾问收入1.46亿，保荐服务收入1071万。另外，截至报告期末，公司完成73家企业在新三板的挂牌，排名行业第22位。

(4) 资产管理业务收入

目前资管业务方面已成立运行60支集合理财产品，集合资管计划规模共计257.32亿，成立并运作的定向资产计划有158支，受托管理资产规模为359.72亿。2015年全年实现受托客户资产管理业务净收入1.65亿，较2014年实现了近三倍的增长。

2、营业支出：2015年合并营业支出为19.42亿元，其中业务及管理费17.28亿，营业税金及附加为1.71亿元，分别较上年度增长126.16%和192.34%。2015年母公司营业支出为15.86亿元，其中业务及管理费为14.23亿元，较上年增长160.13%；营业税金及附加为1.46亿元，较上年增长238.80%。

表：2015年天风证券（母公司）业务及管理费用 单位：万元

	人力费用	资产使用费	行政及业务费用	投资者保护基金	合计
创新业务部门	68,129.75	3,339.36	12,817.82	2,589.34	49,704.86
经纪业务部门	24,847.77	4,143.06	3,897.99	852.89	24,422.96
其他	7,926.52	4,846.95	8,112.15	840.09	68,215.88
合计	100,904.04	12,329.38	24,827.96	4,282.32	142,343.70

从费用项目上来看，占比最大的仍然是人力资源成本，2015年人力资源费用占总费用的比重为71%。近年来，公司的业务范围在一直不断扩展，持续积极跟进证券行业的各类创新型业务，并稳固传统经纪业务。因此，成立了很多新的业务部门、分支机构和经纪业务营业网点，同时招募了更多数量且更高素质人才，人力成本较去年增加了2.46倍，这也是公司业务及管理费用增长的主要原因，但同时资产使用费和行政及业务费用得到了较好的控制，增长率较低。2016年，公司在持续快速发展和扩建吸收团队的同时，也将持续关注成本问题，注意费用的控制，使盈利效率更加优化。

3、营业外收入：2015年合并营业外收入为800.53万，其中政府补助523.93万，税金返还142.92万。

4、营业外支出：2015年合并营业外支出为1277.31万，其中非流动性资产处置损失1146.01万，对外捐赠128.40万。

5、所得税费用：2015年合并所得税费用为2.76亿。

二、公司资产与负债状况分析

表：2015年和2014年合并资产情况

单位：万元

	2015年12月31日	2014年12月31日	增长额	增长比例
货币资金	539,658.00	201,433.29	338,224.71	168%
其中：客户资金存款	276,331.59	150,604.79	125,726.80	83%
结算备付金	180,625.25	91,673.99	88,951.26	97%
其中：客户备付金	127,475.68	84,554.09	42,921.59	51%
融出资金	162,039.90	134,882.93	27,156.97	20%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	874,019.09	291,736.68	582,282.41	200%
衍生金融资产	199.60	404.97	-205.38	-51%
买入返售金融资产	862,185.00	538,230.11	323,954.89	60%
应收款项	2,590.93	696.58	1,894.35	272%
应收利息	13,083.98	3,140.15	9,943.83	317%
存出保证金	98,138.61	52,084.16	46,054.46	88%
划分为持有待售的资产	2,496.55	7,320.92	-4,824.37	-66%
可供出售金融资产	757,102.46	106,113.81	650,988.66	613%
长期股权投资	114,520.49	5,780.64	108,739.85	1881%
投资性房地产	10,489.55	9,831.07	658.48	7%
固定资产	15,321.34	9,712.79	5,608.55	58%
在建工程	6,686.13	-	6,686.13	
无形资产	8,014.81	6,026.93	1,987.88	33%
商誉	1,759.20	1,555.22	203.97	13%
递延所得税资产	1,223.05	364.33	858.71	236%
其他资产	201,018.30	144,306.24	56,712.06	39%
资产总计	3,851,172.26	1,605,294.83	2,245,877.43	140%

表：2015年和2014年合并负债和权益情况

单位：万元

项目	2015年12月31日	2014年12月31日	增长额	增长比例
----	-------------	-------------	-----	------

项目	2015年12月31日	2014年12月31日	增长额	增长比例
应付短期融资款	193,998.00	3,108.12	190,889.88	6142%
拆入资金	16,700.00	51,320.70	-34,620.70	-68%
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	30,889.22	-30,889.22	-100%
卖出回购金融资产款	1,070,646.55	682,150.85	388,495.70	57%
代理买卖证券款	417,253.93	262,081.59	155,172.34	59%
应付职工薪酬	56,395.43	6,474.81	49,920.62	771%
应交税费	29,720.42	7,035.65	22,684.77	322%
应付款项	3,937.70	5,967.03	-2,029.33	-34%
应付利息	22,008.45	6,290.55	15,717.90	250%
应付债券	573,561.15	134,642.56	438,918.59	326%
递延所得税负债	12,270.02	2,908.38	9,361.64	322%
其他负债	157,311.03	37,632.55	119,678.48	318%
负责总计	2,553,802.68	1,230,502.01	1,323,300.67	108%
项目	2015年12月31日	2014年12月31日	增长额	增长比例
实收资本（股本）	466,200.00	234,113.00	232,087.00	99%
资本公积	304,680.35	26,328.63	278,351.73	1057%
其他综合收益	21,024.67	3,962.39	17,062.28	431%
盈余公积	11,480.08	3,298.16	8,181.92	248%
一般风险准备	24,561.40	8,197.56	16,363.84	200%
未分配利润	90,542.72	21,329.84	69,212.88	324%
归属于母公司所有者权益	918,489.22	297,229.57	621,259.65	209%
少数股东权益	378,880.36	77,563.25	301,317.11	388%
所有者权益总计	1,297,369.58	374,792.82	922,576.76	246%

报告期末公司资产总额为 385.12 亿元，较报告期初增长 140%；负债总额为 255.38 亿，较报告期初增长 108%；所有者权益 129.74 亿，较报告期初增长 246%。下面对资产负债表变动较大的项目予以说明：

1、由于报告期内债券市场整体行情趋势持续走好，公司撮合业务规模稳步增长，其中买入返售金融资产较年初增加 32.40 亿，增长 60%；相对应的卖出回购金融资产较年初增加 38.85 亿，增长 57%；

2、在市场利好的情况下，公司以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产持有量同时大幅上涨，报告期末达到 87.40 亿，较报告期初增长了 58.23 亿，增幅 200%；

3、由于报告期内市场交易的活跃，公司的客户资金存款、结算备付金、存出保证金较报告期初均有不同程度增长，对应的代理买卖证券款也有所增长；

4、报告期内，公司对子公司增加了投资，长期股权投资较报告期初增加了 10.87 亿，增长了 18.81 倍；

5、报告期内发行了 20 亿次级债、12 亿公司债、6.5 亿短期公司债和 42.27 亿收益凭证，也成为负债增长的重要原因，同时带来应付利息较 2014 年增幅较高；

6、公司归属于母公司的所有者权益较报告期初增加了 209%，主要是由于增资扩股和公司盈利的增加，其中报告期内的增资扩股工作（2.2 元/股）使实收资本增加 23.21 亿，资本公积增加 27.85 亿，同时也带动了公司货币资金的增长。另外未分配利润增加 6.92 亿，增长了 324%。

三、现金流量情况分析

1、经营活动现金流量：

经营活动产生的现金流量净额为-22.20亿元，其中：

现金流入 1568.94 亿，其中：收取利息、手续费及佣金的现金 23.26 亿元；代买卖证券款收到的现金净额为 1568.34 亿；回购业务资金净增加额 6.36 亿；

现金流出 1591.15 亿，其中：融出资金净增加额 2.76 亿，代理买卖证券支付的现金净额为 1555.00 亿；支付给职工以及为职工支付的现金 5.89 亿元；支付的各项税费 1.82 亿元；

2、投资活动现金流量：

投资活动产生的现金流量净额为-75.22 亿元，其中：

(1) 收回投资收到的现金 23.82 亿，投资收益收到现金 1.06 亿；

(2) 投资支付的现金 95.54 亿元，购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 2.68 亿；

3、筹资活动现金流量：

筹资活动产生的现金流量净额为 140.14 亿，其中：

(1) 吸收投资收到现金 79.51 亿，其中子公司吸收少数股东投资收到的现金 28.45 亿；

(2) 发行收益凭证取得借款 42.27 亿；发行债券取得借款 38.23 亿，其中发行次级债 20 亿、公司债 12 亿和短期公司债 6.5 亿；

(3) 偿还收益凭证 17.68 亿，利息支付现金 2.11 亿；

4、现金及现金等价物净增加额 42.72 亿元；

5、年末现金及现金等价物余额 72.03 亿，较 2014 年同期的 29.31 亿，增加了 145.74%。

四、核心竞争力分析

1、快速发展与风险控制并重的积极、稳健的经营风格。

本公司自成立以来始终秉持稳健的经营风格，有效降低了市场周期波动带来的业绩波动，较好的规避了市场风险，保证了经营业绩在高度重视风险控制、风险可承受的前提下快速增长。同时公司及时把握行业改革创新机遇，成功实现各项业务的创新发展。

高度重视风险管理和内部控制是公司稳健经营的重要体现。本公

司已经建立了有效的风险管理和内部控制体系，实现了业务发展与规范运作的融合、一线风险管控与专职风险管控部门的融合、前后台部门之间的融合，提升了公司的风险管理能力，为公司近年来的创新转型和持续发展提供了有效保障。

2、人才团队与企业文化

本公司具有较强的多行业金融人才集聚能力和良好的年轻求职者吸聚、培训、再发掘的机制，报告期内公司通过人才的吸引和培养取得了跨越式的发展，也充分认识到“人才引领创新、人才驱动资本、人才放大价值”是本公司未来摆脱同质化竞争、增加利润增长点的关键所在之一。

本公司高管团队具有年轻化、学历高、金融混业管理经验丰富、业务能力强、集体成就导向等特点，是公司快速稳定发展的重要因素。公司高管团队成员 73%是 70 后人员，大多数拥有博士或硕士学位，工作持续、勤奋、忘我，有着长期坚持在证券业务领域服务的精力和职业规划。公司近年来通过引进和培养出一批以 85 后为主的 80 年骨干人才，年轻精英的汇聚将有利于公司战略的长期发展与协作落地，进而将成功带领公司实现平稳、快速的成长。

公司建立了相对完善的考核机制。公司绩效评估透明，针对各主营业务的盈利模式特点，分别设定了相应的考核激励制度，确保每个参与价值创造的员工都获得认可和回报，以充分调动员工的积极性，挖掘员工创造力。

公司十分注重企业文化建设。针对金融行业人才高学历等的特点，

公司营造互利共赢的类合伙文化，公司在合法合规的前提下授予一线管理人员较为充分的业务管理权责。并把“勤奋、团结、真诚、坚毅、平等、开放”企业文化的内涵纳入各类员工招聘、培训、考核、晋升体系中，把企业文化理念贯穿于公司发展和经营管理过程中的各个方面。公司以文化凝聚人才，打造强有力的人才团队迎接证券行业新的挑战。

3、富有竞争力的新三板业务

新三板业务是我公司重要的创新业务之一。公司设立了中小企业服务中心，下设业务管理部、场外市场部、持续督导部及区域业务中心等，为创新型、成长型、科技型中小企业提供新三板挂牌、做市、融资、并购重组、持续督导等服务，推动中小企业的快速发展。

公司自2014年初开展新三板业务以来，予以大力投入和重点支持，使得新三板业务快速发展，跻身行业前列。公司重视项目标的的选择，在为优质中小企业提供推荐挂牌服务的同时，充分考虑企业的资本市场需求，注重为其提供后续做市交易、融资、并购等综合服务，与客户一同成长、共同发展。

4、迅速成长的固定收益业务

公司固定收益业务包括自营交易、研究等业务，已获得现货、期货、期权、利率互换等多种现货及衍生品的交易资格；同时获得银行间市场尝试做市商资格，是中国近万家金融机构中首批获此牌照机构之一。

公司固定收益业务正在向商品、外汇等多领域拓展，向国际化的

大固定收益即 FICC 多类业务模式发展。固定收益总部秉承多类资产投资运作的大固收业务理念，旨在建立“全天候”大类资产配置交易模式，构建以在固定收益为核心的基础上涵盖多类资产的立体交易策略，做绝对收益的探索者与追求者。

五、公司破产重整，兼并、分立以及子公司、分公司、营业部新设和处置等重大情况

1、 破产重组相关事项

报告期内公司无破产重组相关事项。

2、 公司兼并或分立情况

报告期内公司无兼并或分立情况。

3、 子公司、分公司、营业部新设和处置情况

报告期内，公司新设 1 家子公司：天风创新投资股份有限公司；1 家分公司：天风证券股份有限公司天津分公司；7 家营业部：广州华夏路证券营业部、上海国宾路证券营业部、上海马当路证券营业部、襄阳东风汽车大道证券营业部、北京海淀长春桥证券营业部、重庆沧白路证券营业部、上海漕溪北路证券营业部。新的子公司、分公司及营业部的设立，填补了空白省份经营版图，完善了公司战略布局。

上述新设子公司、分公司、营业部因尚未形成较强的盈利能力，对公司本报告期业绩影响较小。

4、 公司特殊目的主体新设和处置情况

报告期内公司无特殊目的主体设立和处置情况。

5、 重大的资产处置、收购、置换、剥离情况

2014年8月，天风证券出资2.97亿元增资认购宜宾市商业银行11880万股股份，持股比例9.90%；2015年5月，天风证券出资2.42973亿元受让宜宾商行5608.35万股股份，增资且竞拍后持股比例14.57%。2015年11月30日，中国银监会四川监管局正式批复天风证券成为宜宾市商业银行单一第一大股东，这是国内首例证券公司为商业银行单一第一大股东。

报告期内，公司无重大的资产置换、剥离情况。

6、重组其他公司情况

报告期内，公司无重组其他公司情况。

六、公司经营活动中可能面临的风险和应对措施

报告期内，公司致力于建立与自身经营战略及风险偏好相匹配的、全面的风险管理架构体系、风险管理模式和方法，确保公司长期稳定、健康发展。公司经营管理中面临市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险以及其他风险。公司针对经营中的各类风险制定相应的应对措施防范各类风险状况。

1、风险管理概况

(1) 风险管理架构

公司建立了全面风险管理体系，建立了由四个层级组成的风险管理组织架构。第一层级为董事会及董事会下设的风险管理委员会；第二层级为公司执行委员会及执行委员会下设的风险管理专业委员会、首席风险官；第三层级为风险管理部、合规法律部、稽核审计部、财务核算部、资金计划部、品牌管理部等风险管理部门；第四层级为各

业务部门和分支机构。公司风险管理组织架构各层级的职责和分工如下：

公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，负责制定风险管理战略和风险管理政策，确定风险管理原则，根据环境的变化和业务的发展不断检验风险管理政策的有效性以使其不断完善，并将风险管理纳入整体经营发展战略。董事会下设风险管理委员会，主要负责研究制定公司总体风险控制和风险管理政策，审查公司风险控制体系及其有效性，监控、检查公司经营管理和业务运作，审查公司内部风险控制制度的落实情况，研究制定公司重要风险的界限以及董事会赋予的其他职责。

公司执行委员会是公司全面风险管理工作的组织机构，负责在董事会授权范围内，审批公司风险限额的分配方案、各项业务的风险额度、净资本补足方案的具体实施等董事会授权事项。公司执行委员会对公司全面风险管理的有效性承担主要责任。

风险管理专业委员会是公司执行委员会下设的专门工作机构，对公司执行委员会负责并报告工作。风险管理专业委员会主要负责对公司的整体风险状况进行评估，研究确定公司风险控制指标，对公司的总体风险管理进行监督，以确保与公司经营活动相关的各种风险控制合理的范围内。公司首席风险官负责统筹公司风险管理工作，执行风险管理专业委员会制定的风险管理政策；制定风险管理的程序和操作规程，并监督其落实；有效识别、计量、监测和控制各项业务所承担的风险；负责对风险评估报告、创新业务方案等进行审查。

公司风险管理部、合规法律部、稽核审计部是公司的专职风险管理部门，分别独立行使相应的风险管理职能，与财务核算部、资金计划部、信息技术部、品牌管理部等公司内部控制部门对公司面临的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、声誉风险等主要风险进行事前、事中和事后管理，并负责沟通协调相关的风险管理工作。公司在开展新业务、新产品、扩大现有业务规模前，由风险管理部、合规法律部与业务部门共同负责进行合规性审查及风险评估工作，综合分析最大可能的风险水平是否在公司可承受的范围内。合规法律部、风险管理部还通过审查部门业务规章制度、各种对外合同的合规性，从制度建设、风险识别等方面对各项业务的风险进行事前控制。公司在办公流程中嵌入了合规审查和风险评估节点，合规法律部和风险管理部归口人员通过对流程的处理，及时识别、评估和处理证券自营业务、资产管理业务、投资银行业务、经纪业务、融资融券、股票质押式回购交易业务、约定购回式业务、新三板做市商业务等各类业务中的风险。合规法律部、风险管理部负责分别对证券自营业务、经纪业务、融资融券业务、资产管理业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式业务、新三板做市、交易类创新业务及净资本等相关风险控制指标进行监控，对监控中发现的异常事项进行警示、上报并报送相关部门，通过实时监控系统的实现各项业务风险的事中控制，并对业务风险进行不定期评估。稽核审计部通过现场稽核、非现场稽核、专项稽核等多种稽核方式对各项业务的合法合规性、内部控制的有效性进行独立的内部审计，对各项业务风险进行事后控制，对公司内部控

制的健全性、有效性进行评价。

公司各业务部门及分支机构负责人为本部门风险管理的第一责任人，负责履行一线风险管理职能，按照公司风险管理的要求，将风险管理覆盖到所有业务流程和岗位。公司各业务部门及分支机构设立了履行合规与风险管理职责的专岗，协助本部门负责人对所开展的业务进行风险识别、评估、管理和控制。

（2）风险管理制度体系

公司根据《证券公司全面风险管理规范》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司流动性风险管理指引》等监管规定，制定了《天风证券股份有限公司风险管理文化手册》、《天风证券股份有限公司风险管理文化手册》，详细规定了包括但不限于风险管理基本原则、风险管理环境与风险文化、风险偏好与风险容忍度、风险管理的组织架构与职责、风险管理方法、风险的沟通方法与揭示、风险管理问责、风险管理评价与考核等内容。公司的风险管理制度体系涵盖了市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等各类风险管理制度以及综合类风险管理制度。

（3）风险管理指标体系

公司建立了包括风险偏好、风险容忍度、风险限额等风险管理指标体系。风险偏好是董事会和经营决策层在分析公司面对的各种风险因素的基础上，确定的对风险收益平衡关系的基本态度。风险容忍度是公司根据风险偏好，针对不同业务的风险特征，为每一个具体业务

设定的风险管理效用的量化限额指标。公司建立了以风险限额为核心的业务授权管理体系，在法定经营范围内，根据决策事项的风险等级实行逐级业务授权，并根据各单位的风险管理能力、业务授权执行情况、实际风险控制结果，实行审慎授权，在风险可控的前提下，提高决策效率。公司禁止越权操作，各级被授权人必须在权限范围内行使权力，开展业务活动。

（4）风险管理文化

风险管理文化是一个企业的信念和态度，反映主体价值观，影响企业文化、经营风格与决策。公司风险管理文化定义为“全面、全员、主动、审慎”。根据公司风险管理文化要求，公司风险管理坚持业务风险在可测、可控、可承受的前提下主动管理风险，实现价值最大化。

（5）风险管理信息系统

公司在风险管理实践中深刻认识到 IT 系统是做好风险管理的重要工具，并持续加大风险管理 IT 系统的投入与建设工作。目前公司已形成日常实时行情获取、业务风险状态监控、风险量化分析与计算的风险管理信息系统。随着公司业务发展创新和风险管理优化深入，风险管理 IT 系统会持续发展、升级、完善。

2、市场风险及其应对措施

（1）市场风险概况

市场风险是指因市场价格（权益类证券价格、利率、汇率或商品价格等）的不利变动而使得公司各项业务发生损失的风险。市场风险可分为权益类价格风险、利率风险、汇率风险、商品价格风险等，分别指由

于权益类价格、利率、汇率风险、商品价格等变动而给公司带来的风险。因投资范围受限，证券公司自身所面临的市场风险主要集中在权益类价格风险、利率风险和商品价格风险上。此外，国内场内和场外衍生品市场正处在起步阶段，相应的市场机制还不完善，可使用的有效风险对冲工具缺乏。衍生品市场的高速发展不仅增加了证券公司所承担的市场风险敞口，同时增加了证券公司面临的市场风险的复杂性，对证券公司的市场风险管理提出了更大的挑战。

（2）市场风险管理

风险管理部根据公司风险偏好设定公司市场风险容忍度，并通过识别、评估、计量、监督及管理等措施，确保公司所承受的市场风险在公司设定的风险容忍度以内。公司市场风险管理的具体措施包括：

①持续积极改善 VaR 风险计算模型，包括增加新开拓市场的风险因子，优化计算方法等。同时，公司通过回溯测试等方法，对 VaR 计算模型的准确性进行持续检测。

②压力测试是风险测量中 VaR 计算方法重要和必须的补充工具。压力测试是公司市场风险管理的重要组成部分，公司的压力测试分为综合压力测试与专项压力测试。在压力测试中，公司设置了一系列宏观及市场场景，计算公司全部或特定投资组合持仓在单一情景或多情景同时发生时的可能损失。通过压力测试，对组合持仓面临极端情况冲击下的可能损失状况进行评估，了解单一风险因子或特定压力情景下公司的可能损失，进行风险收益分析，考察公司各项关键监管指标是否符合要求，以及对公司整体的影响是否在可承受的范围内。

3、信用风险及其应对措施

(1) 信用风险概况

信用风险是指发行人、交易对手未能履行合同所规定的义务或由于信用评级的变动或履约能力的变化导致债务的市场价值变动,从而对公司造成损失的风险。公司目前面临的信用风险主要集中在债券投资业务、衍生品交易业务、融资融券业务、约定式购回业务、股票质押式回购业务等业务。随着证券行业创新业务的不断发展,公司承担的各类信用风险日趋复杂。

(2) 信用风险管理

公司通过有效风险识别、审慎风险评估和决策、动态风险计量和监控、风险及时报告和应对等方式,对信用风险实施全程管理,以期能有效防范或避免风险事件的发生、降低风险事件对公司造成的损失并在信用风险可以接受的范围内实现收益最大化。

4、操作风险及其应对措施

(1) 操作风险概况

操作风险是指由不完善的内部程序、人员管理系统以及外部事件所造成损失的风险。证券公司的操作风险贯穿于公司各部门及业务条线(包括前台业务部门和中后台支持部门),具有覆盖面广、种类多样的特点,既包括发生频率高、但损失相对较低的日常业务流程处理的纰漏,也包括发生频率低但会引发重大影响的突发事件,使得操作风险管理成为证券公司贯彻落实全面风险管理目标的重要一环。随着公司创新业务的不断增加、业务流程的日趋复杂,如未能及时识别各业务条线和日常

经营的操作隐患并有效采取缓释措施，可能会导致公司相关业务流程设置不清晰、未得到有效执行，或因工作人员故意或过失导致公司内控机制受到限制或失去效用，从而引发操作风险，产生财务与声誉的损失。

（2）操作风险管理

公司注重制度的可操作性、标准化、设计的科学性和有效性，大力推动流程建设常态化。公司着力建设“业务控制自查、风险监控、内控稽核”的三道防线对操作风险进行管理，确保各业务线条全面覆盖、充分监督。业务部门负责所辖业务的管理制度、流程建设，管理、监控和报告各项业务和管理中的操作风险；风险管理部、合规法律部作为管理操作风险的职能部门，提供管理工具、方法，制定管理标准，综合分析报告；稽核审计部对操作风险管理、控制、监督体系进行后续监督和责任追究。

5、流动性风险及其应对措施

（1）流动性风险概况

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。流动性风险因素及事件包括但不限于：资产负债结构不匹配、资产变现困难、经营损失、交易对手延期支付或违约，以及信用风险、市场风险、声誉风险等类别风险向流动性风险的转化等。公司将流动性视为生命线，并将流动性风险管理作为风险管理第一要务，通过持续、积极、主动的流动性管理及流动性风险识别、计量、监测及控制，及时有效防范及管理公司流动性风险。

（2）流动性风险管理

公司储备了国债、央票等在极端情况下仍可随时变现的高流动性资产，以备意外支出。公司积极开展资金缺口管理，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，及早识别潜在风险，提前安排融资和调整业务用资节奏，有效管理支付风险。

七、公司动态风险控制指标监控机制与净资本补足机制建立情况

1、报告期内公司动态风险控制指标监控机制建立情况

为了建立健全风险控制指标动态监控机制，加强风险监控，在风险可测、可控、可承受前提下开展各项业务，公司根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》对风险控制指标动态监控系统建设、运行及管理模式等方面做了统一规划，并根据监管标准的调整及时升级与完善系统，并由专人负责以净资本为核心的风控指标监测和报告工作，充分评估各板块对监管资本的占用情况，及时揭示风险。根据公司实际情况设计风控指标的内部分级预警处理机制，通过上述措施，确保净资本等各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。公司定期向监管部门书面报告风险控制指标数据和达标情况，就指标波动幅度达到 20%的情况及时进行分析，并向公司领导层和监管机构履行了报告义务。

2、净资本补足机制的建立情况

公司制订了《风险控制指标动态监控实施办法》、《压力测试管理办法》，明确了与净资本动态监控、应急处理、压力测试等工作相关的各部门职责。公司已建立净资本补足机制，根据净资本状况采用压缩风险性较高的投资经营品种规模、调整证券投资品种和结构、追讨往来账

款、转让长期股权投资、处置有形或无形资产、加大提取任意盈余公积、减少或暂停利润分配、发行次级债或公司债、募集资本金等方式及时补充资本金，以保证净资本等各项风险控制指标持续符合监管部门要求。

八、报告期内发生重大会计差错更正需追溯重述的情况说明

报告期内，公司无需追溯重述的重大会计差错重述事项。

九、公司利润分配及分红派息情况

报告期内公司未进行利润分配及分红派息。

第四章 股本变动及股东情况

一、公司实收资本在报告期内的变动情况

报告期内本公司实收资本总额由 234,113 万元增加至 466,200 万元。2015 年 6 月 30 日，中国证监会湖北监管局出具《关于接收天风证券股份有限公司增加注册资本且股权结构未发生重大调整备案文件的回执》，对此次增资事宜进行备案。

新增的注册资本中，武汉国资出资 21,363.64 万元，人福医药出资 13,636.36 万元，湖北省联发出资 21,363.64 万元，宁波信达出资 21,000.00 万元，中航信托出资 20,000.00 万元，苏州建丰出资 18,400.00 万元，当代科技出资 4,549.52 万元，恒健通出资 6,000.00 万元，银海置业出资 3,000.00 万元，上海天阖出资 10,170.02 万元，融鼎富出资 10,000.00 万元，上海潞安出资 1,713.44 万元，上海天涵出资 8,059.99 万元，光大金控出资 7,250.00 万元，四川华西出资 1,410.41 万元，上海天霁出资 6,770.00 万元，武汉铁源出资 1,500.00 万元，苏州湾流出资 6,000.00 万元，富沃投资出资 6,000.00 万元，麦肯特出资 5,000.00 万元，成都奎星出资 5,000.00 万元，武汉新洪出资 3,050.00 万元，嘉兴元泽出资 4,600.00 万元，鄂西投资出资 4,500.00 万元，宁波厚泽出资 4,000.00 万元，上海广承出资 3,000.00 万元，三特索道出资 450.00 万元，武汉恒泰出资 2,500.00 万元，光谷投资担保出资 2,200.00 万元，银丰棉花出资 2,000.00 万元，九天广告出资 2,000.00 万元，武汉瀛孚出资 1,100.00 万元，新金投资出资 1,000.00 万元，荆州古城国投出资 1,000.00 万元，武汉融景出资

1,000.00 万元，中灏投资出资 1,000.00 万元，光兴投资出资 500.00 万元。本次出资均为货币出资，增资价格为每股 2.2 元。由于本次增资的资金分三期到账，2015 年 4 月 10 日、2015 年 5 月 29 日、2015 年 6 月 24 日，大信会计师事务所（特殊普通合伙）分别出具《验资报告》（大信验字【2015】第 2-00025 号、大信验字【2015】第 2-00046 号、大信验字【2015】第 2-00059 号），对本次增资进行了验证。

1、报告期末，公司股东总数共四十七家，公司股东持股情况如下：

股东名称	增资前持股数 (股)	本年增加持股 数(股)	增持后持股数 (股)	增持后持股 比例
武汉国有资产经营公司	423,016,391	213,636,364	636,652,755	13.66%
人福医药集团股份公司	386,780,623	136,363,636	523,144,259	11.22%
湖北省联合发展投资集团有限公司	305,723,360	213,636,364	519,359,724	11.14%
陕西大德投资集团有限责任公司	229,410,093	-	229,410,093	4.92%
宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	-	210,000,000	210,000,000	4.5%
中航信托股份有限公司	-	200,000,000	200,000,000	4.29%
苏州建丰九鼎投资中心（有限合伙）	-	184,000,000	184,000,000	3.95%
武汉高科国有控股集团有限公司	150,168,322	-	150,168,322	3.22%
武汉当代科技产业集团股份有限公司	102,832,976	45,495,186	148,328,162	3.18%
武汉恒健通科技有限责任公司	80,732,645	60,000,000	140,732,645	3.02%
湖北省科技投资集团有限公司	133,712,820	-	133,712,820	2.87%
武汉银海置业有限公司	96,177,066	30,000,000	126,177,066	2.71%
上海天阖投资合伙企业（有限合伙）	-	101,700,182	101,700,182	2.18%
北京融鼎富投资管理有限公司	-	100,000,000	100,000,000	2.15%
上海潞安投资有限公司	66,856,410	17,134,395	83,990,805	1.8%
上海天涵投资合伙企业（有限合伙）	-	80,599,864	80,599,864	1.73%

武汉市仁军投资咨询有限责任公司	76,662,462	-	76,662,462	1.64%
宁波光大金控财智汇通股权投资中心（有限合伙）	-	72,500,000	72,500,000	1.56%
四川华西集团有限公司	55,032,377	14,104,055	69,136,432	1.48%
上海天霁投资合伙企业（有限合伙）	-	67,699,954	67,699,954	1.45%
武汉市铁源物资有限公司	52,434,150	15,000,000	67,434,150	1.45%
苏州湾流重明投资中心（有限合伙）	-	60,000,000	60,000,000	1.29%
富沃投资（江苏）有限公司	-	60,000,000	60,000,000	1.29%
深圳麦肯特中南投资有限公司	-	50,000,000	50,000,000	1.07%
成都奎星物流有限公司	-	50,000,000	50,000,000	1.07%
武汉新洪农工商有限责任公司	19,364,594	30,500,000	49,864,594	1.07%
武汉道博股份有限公司	49,082,732	-	49,082,732	1.05%
武汉奥兴高科技开发有限公司	49,077,434	-	49,077,434	1.05%
嘉兴元泽投资中心（有限合伙）	-	46,000,000	46,000,000	0.99%
湖北省鄂西生态文化旅游圈投资有限公司	-	45,000,000	45,000,000	0.97%
宁波厚泽顺势股权投资合伙企业（有限合伙）	-	40,000,000	40,000,000	0.86%
上海广承投资管理中心（有限合伙）	-	30,000,000	30,000,000	0.64%
武汉三特索道集团股份有限公司	21,309,435	4,500,000	25,809,435	0.55%
武汉恒泰睿风投资合伙企业（有限合伙）	-	25,000,000	25,000,000	0.54%
武汉光谷投资担保有限公司	-	22,000,000	22,000,000	0.47%
湖北银丰棉花股份有限公司	-	20,000,000	20,000,000	0.43%
广东九天影视广告有限公司	-	20,000,000	20,000,000	0.43%
上海和生投资有限公司	11,090,000	-	11,090,000	0.24%
四川创美实业有限公司	11,090,000	-	11,090,000	0.24%

武汉瀛孚投资管理中心 (普通合伙)	-	11,000,000	11,000,000	0.24%
湖北京山轻工机械股份有限公司	10,576,110	-	10,576,110	0.23%
上海鼎石投资管理有限公司	10,000,000	-	10,000,000	0.21%
武汉新金投资管理有限公司	-	10,000,000	10,000,000	0.21%
荆州市古城国有投资有限责任公司	-	10,000,000	10,000,000	0.21%
武汉融景科技投资有限公司	-	10,000,000	10,000,000	0.21%
武汉中灏投资有限公司	-	10,000,000	10,000,000	0.21%
武汉光兴投资管理有限公司	-	5,000,000	5,000,000	0.11%

2、报告期末公司持股 5%以上股东所持股权质押情况

2014 年 11 月 10 日，武汉国有资产经营公司办理了所持天风证券股权质押登记手续，出质期五年。其中，出质股权数额为 108,413,388 股，质权人为武汉农村商业银行股份有限公司江汉支行。

3、报告期末持股 10%以上股东情况

(1) 武汉国有资产经营公司

法定代表人：杨国霞

董事长：杨国霞

总经理：黄家琦

主营业务：授权范围内的国有资产经营管理；国有资产产权交易；信息咨询；代理及中介服务。

注册资本：1,238,340,000 元

(2) 人福医药集团股份公司

法定代表人：王学海

总 经 理：李杰

主营业务：药品研发；生物技术研发；化工产品（化学危险品除外）的研发、销售；技术开发、技术转让及技术服务；货物进出口、技术进出口、代理进出口（不含国家禁止或限制进出口地货物或技术）；对产业的投资及管理、教育项目的投资；房地产开发、商品房销售（资质叁级）；组织“三来一补”业务。（上述范围中国家有专线规定的项目经审批后或凭许可证在核定期限内经营）

注册资本：1,286,049,062元

（3）湖北省联合发展投资集团有限公司

法定代表人：李红云

总经理：刘行念

主营业务：对基础设施、高新技术产业、节能环保产业以及其他政策性建设项目的投资；委托投资及资产管理业务；土地开发及整理；园区建设；风险投资业务；房地产开发业务；工程施工与设计；商贸（不含许可经营项目）、仓储（不含危化品）物流（不含道路运输）业务；对项目的评估、咨询和担保业务（融资性担保业务除外）；国际技术、经济合作业务。

注册资本：4,328,339,232.79元

第五章 董事、监事、高级管理人员和员工情况

一、报告期内董事、监事及高级管理人员情况

1、董事

姓名	职务	性别	年龄	任职起始日期	持有公司股份数量	持有公司期权数量
余磊	董事长	男	37	2012年2月14日	无	无
张军	董事	男	46	2012年2月14日	无	无
张小东	董事	男	64	2012年2月14日	无	无
王含冰	董事	男	37	2012年7月23日	无	无
杜越新	董事	男	57	2012年2月14日	无	无
黄其龙	董事	男	51	2012年2月14日	无	无
艾娇	董事	女	38	2012年2月14日	无	无
雷迎春	董事	女	50	2013年1月11日	无	无
付扬	董事	男	33	2013年12月16日	无	无

2、独立董事

姓名	职务	性别	年龄	任职起始日期	持有公司股份数量	持有公司期权数量
陆德明	独立董事	男	50	2014年4月25日	无	无
黄孝武	独立董事	男	48	2015年4月2日	无	无
宁立志	独立董事	男	51	2015年4月2日	无	无
陈波	独立董事	男	38	2015年4月9日	无	无
潘敏	独立董事	男	49	2015年6月5日	无	无

3、监事

姓名	职务	性别	年龄	任职起始日期	持有公司股份数量	持有公司期权数量
潘思纯	监事长	男	59	2015年8月3日	无	无
郭岭	监事	男	55	2014年9月2日	无	无
戚耕耘	监事	男	53	2012年2月14日	无	无
范晓玲	监事	女	52	2013年12月9日	无	无

4、高级管理人员

姓名	职务	性别	年龄	任期起始日期	持有公司股份数量	持有公司期权数量
张军	总经理	男	46	2012年2月14日	无	无
吴建钢	副总经理	男	43	2012年2月14日	无	无
黄其龙	副总经理 董事会秘书	男	51	2012年2月14日 2014年4月日	无	无
冯琳	财务总监	女	44	2012年7月6日	无	无
王琳晶	副总经理	男	40	2013年5月7日	无	无
吕英石	副总经理	男	38	2013年7月4日	无	无
冯文敏	副总经理	男	43	2014年4月28日	无	无
翟晨曦	副总经理	女	36	2015年4月3日	无	无
朱俊峰	副总经理	男	42	2015年4月18日	无	无
许欣	副总经理	男	40	2015年5月15日	无	无
洪琳	合规总监	女	47	2015年11月19日	无	无

二、现任董事、监事、高管人员简介

1、董事

余磊，董事长，男，1978年生，中国国籍，无境外永久居留权。法学专业，博士研究生学历。曾担任人福医药副总经理兼董事会秘书。2011年3月至报告期末担任武汉市雅达教育投资有限公司董事。2012年2月至报告期末担任当代科技董事。2015年2月至报告期末担任上海天闾普通合伙人/执行合伙人。2015年1月至今报告期末担任武汉九恒投资有限责任公司董事。2015年7月至报告期末担任北京明诚金石投资管理有限责任公司董事。2015年起至报告期末担任湖北繁星科技产业有限公司董事。2006年11月加入天风有限并担任董事长。2012年2月至报告期末，担任天风证券董事长。

张军，董事、总裁，男，1969年生，中国国籍，无境外永久居留

权。经济学专业，博士研究生学历。曾担任君安证券有限责任公司研究员、国泰君安证券股份有限公司总裁办经理、资产管理部总经理、华林证券有限责任公司副总裁。2012年9月至报告期末担任湖北省证券业协会副会长。2013年4月至报告期末担任武汉股权交易中心董事。2006年11月加入天风有限并担任总裁。2012年2月至报告期末，担任天风证券董事、总裁。

张小东，董事，男，1951年生，中国国籍，无境外永久居留权。中国现代文学专业，硕士研究生学历。曾担任湖南师范大学中文系教师、武汉大学新闻系教师、广州《青年探索》杂志社编辑部主任。1988年9月至报告期末担任当代科技董事。1997年6月至报告期末担任人福医药董事。2011年3月至报告期末担任武汉市雅达教育投资有限公司董事，2015年1月至报告期末担任武汉九恒投资有限责任公司董事。2015年7月至报告期末担任北京明诚金石投资管理有限公司董事。2012年2月至报告期末，担任天风证券董事。

杜越新，董事，男，1958年生，中国国籍，无境外永久居留权。经济学专业，硕士研究生学历。曾担任国务院办公厅调研室主任科员、国务院研究室副处长和处长、北京锦江西妮药业有限公司董事长、中国诚信证券评估有限公司总经理、北京储康保健科技有限公司董事长。1993年5月至报告期末担任中国嘉德国际拍卖有限公司董事。2004年12月至报告期末担任中诚信投资有限公司董事。2005年3月至报告期末担任人福医药监事长。2010年5月至报告期末担任北京珞珈教育科技中心有限公司董事长。2013年10月至今担任中国诚信信用管理股份有限公

司董事。2014年11月至报告期末担任嘉德投资控股有限公司董事长。2014年12月至报告期末担任深圳市朗格空气净化科技开发有限公司董事长。2012年2月至报告期末，担任天风证券董事。

黄其龙，董事、副总裁、董事会秘书，男，1964年生，中国国籍，无境外永久居留权。国民经济计划与管理学专业，硕士研究生学历。曾担任中国人民解放军军事经济学院财务系讲师、武汉市硚口区经计委科员、武汉国资部门副经理和经理、武汉华汉投资管理有限公司总经理。2007年3月加入天风有限并先后担任总经理助理、副总裁。2012年2月至报告期末，担任公司副总裁、董事。2013年4月至报告期末，担任天风天睿董事长。2013年7月至报告期末，担任睿信资本董事。2015年9月至报告期末，担任湖北三环资本管理有限公司董事。2014年4月至报告期末，担任公司董事会秘书。

艾娇，董事，女，1977年生，中国国籍，无境外永久居留权。世界经济专业，硕士研究生学历。曾担任武汉国资主办、高级主办、办公室副主任、办公室主任、中百控股集团股份有限公司董事。2014年3月至报告期末担任武汉国资董事会秘书、总经理助理、策划部经理。2015年12月至报告期末担任国创资本董事。2012年2月至报告期末，担任公司董事。

王含冰，董事，男，1978年生，中国国籍，无境外永久居留权。法学专业，硕士研究生学历。曾担任湖北省联发发展企划部部长、总经济师及投资管理部部长、武汉花山生态新城投资有限公司董事及副总经理、湖北城际铁路有限责任公司监事长、武汉联合发展港口有限

公司董事长、武汉东湖高新集团股份有限公司董事、武汉金融资产交易所有限公司监事长。2010年3月至报告期末，担任湖北联投矿业有限公司董事。2013年10月至报告期末湖北省担保集团有限责任公司董事长，2014年5月至今担任湖北省联发副总经理、党委委员。2014年10月至报告期末担任湖北荆丰投资管理有限公司董事。2015年9月至报告期末担任湖北联合创新基金管理有限公司董事。2015年12月至报告期末担任湖北中经中小企业投资有限公司董事。2012年7月至报告期末，担任公司董事。

雷迎春，董事，女，1965年生，中国国籍，无境外永久居留权。政治教育专业，大学本科学历。曾担任陕西建筑工程总公司子弟一中教师、陕西大德木业有限责任公司董事。1996年12月至报告期末担任陕西大德置业有限公司总经理，2010年10月至报告期末担任中亚能源有限责任公司董事，2011年12月至报告期末担任陕西大德董事长、总裁，2011年3月至报告期末担任陕西常春滕投资管理有限公司董事，2015年4月至报告期末担任陕西大德能源材料有限公司监事。2013年1月至报告期末，担任公司董事。

付扬，董事，男，1982年生，中国国籍，无境外永久居留权。电子商务、信息与通讯技术专业，硕士研究生学历。曾担任武汉新芯集成电路制造有限公司企管部职员、行政部副部长及部长、湖北省科投办公室副主任及主任，武汉光谷融资租赁有限公司董事。2012年5月至报告期末担任湖北省科投投资管理部部长。2012年8月至报告期末担任武汉东湖综合保税区建设投资有限公司董事。2013年1月至报告期末担

任武汉未来科技城投资建设有限公司董事。2014年4月至报告期末担任武汉光谷中心城建设投资有限公司董事长。2014年5月至报告期末担任武汉光谷科信小额贷款股份有限公司董事。2014年5月至报告期末担任武汉华星光电技术有限公司董事。2014年9月至报告期末担任武汉合嘉置业有限公司监事。2015年3月至报告期末担任武汉花山生态新城投资有限公司董事。2015年5月至报告期末担任武汉股权交易中心监事。2015年7月至报告期末担任湖北省科技投资集团(香港)有限公司董事。2013年12月至报告期末,担任公司董事。

陆德明, 独立董事, 男, 1965年生, 中国国籍, 无境外永久居留权。会计理论专业, 博士研究生学历。曾担任浙江省林业科学研究所主办会计、浙江财经学院会计系讲师、财政部会计司会计准则委员会技术研究部负责人、中国证监会会计部会计制度处处长、中国证监会湖南监管局局长助理。2008年8月至报告期末担任浙江新潮控股有限公司副总裁。2014年4月至报告期末, 担任公司独立董事。

黄孝武, 独立董事, 男, 1967年生, 中国国籍, 无境外永久居留权。货币银行学专业, 博士研究生学历。曾担任中南财经大学经济学院讲师, 中南财经政法大学经济学院副教授。2004年9月至报告期末担任中南财经政法大学金融学院教授, 2015年4月至报告期末, 担任天风证券独立董事。

宁立志, 独立董事, 男, 1964年生, 中国国籍, 无境外永久居留权。民商法专业, 博士研究生学历。曾担任武汉大学法学院助教、讲师、副教授, 2006年8月至报告期末担任武汉大学法学院教授。2015

年4月至报告期末，担任天风证券独立董事。

陈波，独立董事，男，1977年生，加拿大国籍。经济学专业，博士研究生学历。2008年7月至报告期末在上海财经大学任教，并于2010年9月起担任国际经贸系副系主任。2015年4月至报告期末，担任天风证券独立董事。

潘敏，独立董事，男，1966年生，中国国籍，无境外永久居留权。经济学专业，博士研究生学历。曾担任武汉大学管理学院教师、助教、讲师，武汉大学商学院教师、副教授。2003年11月至报告期末担任武汉大学经济与管理学院教授。2015年6月至报告期末，担任天风证券独立董事。

潘敏于2015年12月18日向天风证券股份有限公司董事会递交了《关于申请辞去天风证券股份有限公司独立董事的报告》，由于潘敏先生的辞职将导致公司独立董事人数少于董事会成员三分之一的情形发生，截止于报告期末，潘敏先生仍按照有关法律、行政法规和《公司章程》的规定继续履行独立董事职责，其辞职报告将在新任独立董事填补因其辞职产生的空缺后生效。

2、监事

潘思纯，监事长，男，1956年生，中国国籍，无境外永久居留权。理学专业，大学本科学历。曾担任淮北煤炭师范学院物理系教师、系办公室副主任、中国人民银行蚌埠分行科长、中国平安保险（集团）股份有限公司安徽分公司电脑部经理、华安证券有限责任公司（现“华安证券股份有限公司”）经纪业务总部副总经理。2003年10月加入天

风有限并先后担任总裁助理、副总裁。2012年2月至2015年8月担任公司副总裁。2013年3月至2015年8月担任公司合规总监。2015年8月至报告期末，担任公司监事长。

郭岭，监事，男，1960年生，中国国籍，无境外永久居留权。管理科学与工程学专业，博士研究生学历。曾担任中国舰船研究院第710研究所助理工程师、武汉汽车工业大学管理学院讲师、教研室副主任、武汉国资部门副经理、经理、武汉东湖创新科技投资有限公司董事、副总经理、董事长兼总经理。2010年9月至报告期末担任武汉国资董事。2013年12月至报告期末担任武汉智慧产业股权投资基金管理公司董事长。2014年9月至报告期末担任武汉东湖华科投资管理有限公司董事长。2014年9月至报告期末，担任公司监事。

范晓玲，监事，女，1963年生，中国国籍，无境外永久居留权。会计学专业，大学本科学历。曾担任武汉手表厂会计、副科长、科长、总会计师、武汉市东湖财会咨询服务有限公司总经理，武汉长江通信产业集团股份有限公司监事。2001年3月至报告期末先后担任武汉高科财务审计部副部长、部长、总会计师。2009年3月至报告期末担任人福医药董事，2010年4月至报告期末担任武汉光谷投资担保有限公司董事长，2014年10月至报告期末担任武汉光谷新技术产业投资有限公司董事。2013年12月至报告期末担任公司监事。

戚耕耘，监事，男，1962年生，中国国籍，无境外永久居留权。电子专业，大专学历。曾担任电子工业部第十研究所科员、成都联合期货交易所办公室主任。2000年4月加入天风有限并先后担任董事长助

理、董事会办公室主任。2012年2月至报告期末，担任公司监事。

3、高级管理人员

张军。（见本章节“董事”部分）

吴建钢，常务副总裁，男，1972年生，中国国籍，无境外永久居留权。国民经济专业，硕士研究生学历。曾担任上海亚洲商务投资咨询公司研究发展部职员、人福医药董事会秘书、上海保捷投资管理有限公司总经理。2002年6月加入天风有限并先后担任监事、总经理助理、常务副总裁。2012年2月至报告期末担任公司常务副总裁。

黄其龙。（见本章节“董事”部分）

冯琳，财务总监，女，1971年生，中国国籍，无境外永久居留权。会计学专业，硕士研究生学历。曾担任武汉盛源集团股份有限公司会计、大信会计师事务所有限公司副总经理、道博股份财务总监。2009年5月加入天风有限并担任总裁助理。2012年7月至报告期末担任公司财务总监，2015年8月至11月代行公司合规总监。

王琳晶，副总裁、承销分公司总经理，男，1975年生，中国国籍，无境外永久居留权。公共政策专业，博士研究生学历。曾担任国家发展改革委主任科员、中国通达电子网络系统公司总经理助理。2009年11月加入天风有限并担任成都办事处部门负责人。2013年5月至报告期末担任公司副总裁，2011年11月至报告期末担任北京承销分公司总经理。2015年12月至报告期末担任天风创新董事长。

吕英石，副总裁、并购融资总部总经理，男，1977年生，中国国籍，无境外永久居留权。国际商法专业，硕士研究生学历。曾担任中

国成套设备进出口（集团）总公司法律部职员、华泰联合证券有限责任公司并购私募融资总部业务董事。2011年3月加入天风有限并担任并购融资总部总经理，2013年7月至报告期末，担任公司副总裁至今。

冯文敏，副总裁、投资银行总部上海业务部总经理，男，1972年生，中国国籍，无境外永久居留权。工商管理专业，硕士研究生学历。曾担任中国建设银行常州分行国际业务部信贷员、山一国际（香港）有限公司（现“京华山一国际（香港）有限公司”）上海代表处融资科科长、国通证券有限责任公司（现“招商证券股份有限公司”）上海投资银行部高级项目经理、香港顺隆集团上海代表处高级经理、东海证券有限责任公司（现“东海证券股份有限公司”）投资银行部总经理、总裁助理。2013年7月加入天风证券起至报告期末，担任公司副总裁、投资银行总部上海业务部总经理。

翟晨曦，副总裁，女，1979年生，中国国籍，无境外永久居留权。财政学专业，博士研究生学历。曾担任国家开发银行投资业务局副局长、国家开发银行评审三局科长、国家开发银行资金局科长、副处长、处长。2014年4月加入天风证券，2015年4月起至报告期末，担任公司副总裁。2015年12月至报告期末担任天风创新董事兼总经理。

朱俊峰，副总裁，男，1973年3月生，中国国籍，无境外永久居住权。博士研究生学历。1997年8月至1999年11月，担任京华山一国际有限公司上海代表处襄理。2000年12月至2002年12月，担任招商证券投资银行部总经理助理。2003年5月至2014年12月，担任东海证券有限公司副总经理，先后分管投资银行业务、债券承销业务与资产管理业务，

并兼任东海证券首席宏观经济研究员。2015年1月起至报告期末，担任天风证券副总裁。

许欣，副总裁，男，1975年生，中国国籍，无境外永久居留权。产业经济学专业，硕士研究生学历。曾担任中国华融资产管理股份有限公司证券业务部经理、高级副经理、华融证券股份有限公司投资总监、董事会秘书。2015年1月起至报告期末，担任天风证券副总裁。

洪琳，合规总监，女，1968年生，中国国籍，无境外永久居留权。金融专业，大学本科学历。曾任玉林市工商银行解放路营业部职员、广西壮族自治区经济体制改革委员会证券办主任科员、中国证券监督管理委员会广西监管局副局长。2015年9月加入天风证券，2015年11月起至报告期末，担任公司合规总监。

三、报告期内离任董事、监事、高级管理人员及原因

崔忠泽，男，自2015年4月2日起，因退休不能履行职责，不再担任公司独立董事。

何建国，男，自2015年8月3日起，因退休不能履行职责，不再担任公司监事。

潘思纯，男，自2015年8月3日起，因工作调动不能履行职责，不再担任公司副总裁、合规总监。自2015年8月3日起，任公司监事长。

张翔东，男，自2015年6月15日起，因个人原因不能履行职责，不再担任公司副总裁。

四、报告期末专门委员会人员构成情况

1、薪酬与提名委员会

组成人员：潘敏 余磊 宁立志

召集人：潘敏

2、审计委员会

组成人员：陆德明 艾娇 黄孝武

召集人：陆德明

3、风险管理委员会

组成人员：余磊 付扬 宁立志

召集人：余磊

4、发展战略委员会

组成人员：余磊 陈波 黄孝武 宁立志

召集人：余磊

五、报告期内董事、监事、高级管理人员薪酬管理的决策程序

公司董事、监事报酬分别由董事会、监事会制订，报股东大会审议决定；高级管理人员报酬由董事会根据《天风证券股份有限公司高级管理人员考核及薪酬管理暂行办法》和《天风证券高级管理人员薪酬实施细则》审议决定。

六、报告期内董事、监事、高级管理人员报酬情况

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	任职状态	从公司获得的报酬总额（税前）
余磊	董事长	男	37	现任	99.32
张军	董事 总经理	男	46	现任	104.18
张小东	董事	男	64	现任	6.00

王含冰	董事	男	37	现任	0
杜越新	董事	男	57	现任	6.00
黄其龙	董事 副总经理 董事会秘书	男	51	现任	102.15
艾娇	董事	女	38	现任	0
雷迎春	董事	女	50	现任	6.00
付扬	董事	男	33	现任	0
陆德明	独立董事	男	50	现任	6.00
黄孝武	独立董事	男	48	现任	0
宁立志	独立董事	男	51	现任	0
陈波	独立董事	男	38	现任	0
潘敏	独立董事	男	49	现任	0
崔忠泽	独立董事	男	69	离任	6.00
潘思纯	监事长	男	59	现任	104.24
郭岭	监事	男	55	现任	0
戚耕耘	监事	男	53	现任	16.29
范晓玲	监事	女	52	现任	0
何建国	监事	男	60	离任	14.83
吴建钢	副总经理	男	43	现任	1,512.88
冯琳	财务总监	女	44	现任	115.42
王琳晶	副总经理	男	40	现任	1,130.87
吕英石	副总经理	男	38	现任	95.35
冯文敏	副总经理	男	43	现任	105.08
翟晨曦	副总经理	女	36	现任	1,362.41
朱俊峰	副总经理	男	42	现任	22.49
许欣	副总经理	男	40	现任	76.35
张翔东	副总经理	男	43	离任	228.18
洪琳	合规总监	女	47	现任	9.17

七、报告期内母公司及主要子公司员工情况

本公司实行全员劳动合同聘用制，员工的录用按照公开招聘、平等竞争、择优录用的原则。中层管理人员实行竞争上岗，部门业务人员实行双向选择、优胜劣汰。截至报告期末，公司员工统计情况：

营销	296
非营销	1208
合计	1504
经营管理层	26
经纪业务相关	756
投行业务相关	364
自营业务相关	52
资管业务相关	75
研究咨询业务相关	22
其他部门	209
合计	1504
具有研究生及以上学历	479
具有本科学历	690
具有大专学历	260
具有中专及高中学历人员	75
合计	1504
30岁（含）及以下	713
31-40岁	544
41-50岁	210
51岁（含）以上	37
合计	1504

八、报告期内子公司主要子公司员工情况

报告期内，公司主要子公司有天风天睿投资有限公司、天风天盈投资有限公司、天风期货股份有限公司，员工情况如下：

1、天风天睿投资有限公司

管理人员	9
业务人员	40
业务支持人员	15
合计	64

具有研究生及以上学历	28
具有本科学历	29
具有大专学历	5
具有中专及以下学历	2
合计	64
30岁（含）及以下	29
31-40岁	29
41-50岁	5
51岁（含）以上	1
合计	64

2、天风天盈投资有限公司

管理人员	22
业务人员	161
业务支持人员	23
合计	206
具有研究生及以上学历	34
具有本科学历	131
具有大专学历	36
具有中专及以下学历	5
合计	206
30岁（含）及以下	119
31-40岁	79
41-50岁	8
51岁（含）以上	0
合计	206

3、天风期货股份有限公司

管理人员	11
业务人员	82
业务支持人员	55
合计	148

具有研究生及以上学历	33
具有本科学历	85
具有大专学历	25
具有中专及以下学历	5
合计	148
30岁（含）及以下	64
31-40岁	59
41-50岁	20
51岁（含）以上	5
合计	148

4、天风创新投资股份有限公司

天风创新于 2015 年 12 月末完成工商设立登记，相关人员正在陆续招募。

九、委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

根据中国证监会、湖北证监局有关规定，公司制定了《证券经纪人管理规定》《证券经纪人风险管理办法》《证券经纪人执业行为管理办法》《证券经纪人培训管理细则》等一系列内控管理制度，并通过不断完善规章制度、健全内控机制、改进系统支持和强化内部培训的方式，持续加强对公司证券经纪人的集中统一管理，强化规范证券经纪人的执业行为，实现全方位维护客户合法权益的目的。

经纪人接受公司委托，遵守相关行为规范及公司各项规章制度，代理公司从事客户招揽、客户服务活动，客户可通过登录公司网站、查询营业部现场公示等方式查询经纪人执业注册信息。截至报告期末，公司共有 34 家营业部取得实施证券经纪人业务资格，共计证券经纪人 384 名，均已在中国证券业协会完成执业注册。

公司建立风险监控平台，对经纪人所属客户的交易行为进行监控、预警和跟踪处理，有效控制经纪人风险。营业部负责人作为第一管理责任人，全面负责本营业部的经纪人管理工作，并接受公司总部的管理、协调和监督检查。公司总部不定期通过面谈、电话、信函或其他方式对经纪人招揽和服务的客户进行回访，了解经纪人的执业合规情况。2015 年公司持续加强对经纪人的合规展业培训，加强对经纪人的执业行为管理。

第六章 公司治理

一、报告期内公司股东大会、董事会、监事会会议情况

1、股东大会会议情况

(1) 2015年1月5日，公司召开2015年第一次临时股东大会，会议审议通过了《为天风天睿投资有限公司提供担保的议案》。

(2) 2015年2月17日，公司召开2015年第二次临时股东大会，会议审议通过了如下议案：《关于公开发行2015年公司债券具体方案的议案》、《关于授权公司董事会在有关法律法规规定范围内全权办理本次公开发行证券公司债券相关事宜的议案》。

(3) 2015年3月2日，公司召开2015年第三次临时股东大会，会议审议通过了《关于公司增资扩股的议案》。

(4) 2015年4月2日，公司召开2014年年度股东大会，会议审议通过了如下议案：《公司2014年度董事会工作报告》、《关于公司2014年度监事会工作报告》、《公司年度报告（二〇一四年度）》、《公司2014年度财务决算报告》、《公司2015年度财务预算报告》、《关于公司2014年度利润分配方案的议案》、《关于续聘会计师事务所的议案》、《关于修改〈审计委员会议事规则〉的议案》、《关于在董事会下增设发展战略委员会的议案》、《关于修改〈天风证券股份有限公司章程〉部分条款的议案》、《关于公司第一届董事会换届选举的议案》、《关于公司第一届监事会非职工监事换届选举的议案》。

(5) 2015年5月4日，公司召开2015年第四次临时股东大会，审议通过了《关于修改公司章程的议案》。

(6) 2015年6月1日，公司召开2015年第五次临时股东大会，审议通过了《关于选举公司独立董事的议案》。

(7) 2015年8月5日，公司召开2015年第六次临时股东大会，审议通过了如下议案：《关于公开发行短期融资券的议案》、《关于授权公司董事会在有关法律法规规定范围内全权办理本次公开发行证券公司短期融资券相关事宜的议案》、《关于非公开发行短期公司债券的议案》、《关于授权公司董事会在有关法律法规规定范围内全权办理本次非公开发行证券公司短期公司债券相关事宜的议案》、《关于成立天风证券固定收益子公司的议案》。

(8) 2015年8月18日，公司召开2015年第七次临时股东大会，审议通过了如下议案：《关于修订〈关于公司申请首次公开发行人民币普通股（A股）股票并上市的议案〉的议案》、《关于修订〈关于本次公开发行募集资金运用的可行性研究报告〉的议案》、《关于授权董事会全权办理公司首次公开发行人民币普通股（A股）股票并上市相关事宜的议案》。

(9) 2015年9月10日，公司召开2015年第八次临时股东大会，审议通过了如下议案：《关于公司首次公开发行股票并上市后三年内稳定股价预案的议案》、《关于制定〈公司利润分配政策及上市后分红规划方案〉的议案》、《关于招股说明书等事宜的承诺及约束措施的议案》、《关于修订〈董事会议事规则〉的议案》、《关于修订〈公司章程〉的议案》、《关于修订〈股东大会议事规则〉的议案》、《关于制定〈天风证券股份有限公司独立董事制度〉的议案》、《关于制定〈天风证券

股份有限公司对外担保管理制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司对外投资管理制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司关联交易管理制度>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<董事会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<公司章程（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<股东大会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<监事会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司对外担保管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司对外投资管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司关联交易管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司募集资金管理办法（草案）>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司会计政策>的议案》、《关于审议批准公司最近三年及一期审计报告的议案》、《关于发行天风证券 2015 年次级债券的议案》、《关于授权非公开发行次级债券相关事宜的议案》。

（10）2015 年 10 月 14 日，公司召开 2015 年第九次临时股东大会，审议通过了如下议案：《关于审核确认公司最近三年及一期关联交易事项的议案》、《关于成立固定收益子公司并调整注册资本的议案》、《关于变更公司经营范围的议案》、《关于修改公司章程的议案》、

《关于申请授权公司执行委员会根据监管部门批复意见经办调整固定收益子公司设立事宜、变更公司营业范围及修订<公司章程>的议案》。

(11)2015年12月25日,公司召开2015年第十次临时股东大会,审议通过《关于开展贵金属现货合约代理业务和黄金现货合约自营业务的议案》。

2、董事会会议情况

(1)2015年1月20日,公司召开临时董事会会议,会议审议通过了如下议案:《关于申请调整公司信贷业务规模的议案》、《关于拟聘任翟晨曦女士为公司副总裁的议案》、《关于调整公司内部管理机构设置的议案》、《关于2014年下半年风险控制指标监控报告的议案》、《关于2014年年度风险控制指标监控报告的议案》。

(2)2015年2月2日,公司召开临时董事会会议,会议审议通过了如下议案:《关于公开发行2015年公司债券具体方案的议案》、《关于提请股东大会授权公司董事会在有关法律法规规定范围内全权办理本次公开发行证券公司债券相关事宜的议案》。

(3)2015年2月16日,公司召开临时董事会会议,会议审议通过了《关于公司增资扩股的议案》。

(4)2015年3月6日,公司召开临时董事会会议,会议审议通过了《2015年天风证券股份有限公司债券募集资金运用方案及管理制度》及《2015年天风证券股份有限公司债券募集资金运用项目可行性研究报告》。

(5)2015年3月12日,公司召开临时董事会会议,会议审议通

过了如下报告及议案：《公司 2014 年度董事会工作报告》、《公司年度报告（二〇一四年度）》、《关于公司 2014 年度利润分配方案的议案》、《关于续聘会计师事务所的议案》、《关于修改〈审计委员会会议事规则〉的议案》、《关于公司经营管理层授权管理体系调整的议案》、《关于在董事会下增设发展战略委员会的议案》、《关于修改〈天风证券股份有限公司章程〉部分条款的议案》、《关于公司 2014 年度经营工作报告》、《关于公司 2014 年年度合规报告》、《关于调整公司一级风险限额指标的议案》、《关于公司 2014 年风险管理年报》、《关于申请商品期货交易资格的议案》、《关于申请公募基金业务资格的议案》、《关于公司融资融券业务管理办法的议案》、《关于公司第一届董事会换届选举的议案》。本次会议同时审议制定《2014 年度财务决算方案》和《2015 年度财务预算方案》。

（6）2015 年 4 月 18 日，公司召开第二届董事会第一次会议，会议审议通过了如下议案：《关于申请授权执委会确定资本中介类业务规模的议案》、《关于修改公司章程的议案》、《关于调整公司内部管理机构设置的议案》、《关于拟聘任朱俊峰先生为公司副总裁的议案》、《关于选举余磊为公司第二届董事会董事长的议案》、《关于选举公司第二届董事会薪酬与提名委员会、审计委员会、风险管理委员会及发展战略委员会委员及召集人的议案》。

（7）2015 年 5 月 15 日，公司召开第二届董事会第二次会议，会议审议通过了如下议案：《关于调整公司内部管理机构设置的议案》、《关于选举公司独立董事的议案》、《关于拟聘任许欣先生为公司副

总裁的议案》。

(8) 2015年6月15日,公司召开第二届董事会第三次会议,会议审议通过了如下议案:《关于张翔东先生辞去公司副总裁职务的议案》、《关于资本中介类业务管理办法的议案》。

(9) 2015年7月20日,公司召开第二届董事会第四次会议,会议审议通过了如下议案:《关于调整公司内部管理机构设置的议案》、《关于公开发行短期融资券的议案》、《关于提请股东大会授权公开发行短期融资券相关事宜的议案》、《关于非公开发行短期公司债券的议案》、《关于提请股东大会授权非公开发行短期公司债券相关事宜的议案》、《关于开展黄金租赁业务的议案》、《关于成立天风证券固定收益子公司的议案》。

(10) 2015年8月3日,公司召开第二届董事会第五次会议,会议审议通过了如下议案:《关于公司申请首次公开发行人民币普通股(A股)股票并上市的议案》、《关于本次公开发行募集资金运用的可行性研究报告》、《关于授权董事会全权办理公司首次公开发行人民币普通股(A股)股票并上市相关事宜的议案》、《关于召开公司2015年第七次临时股东大会的议案》、《关于潘思纯先生辞去公司副总裁、合规总监、首席风险官、执行委员会委员职务的议案》、《关于指定财务总监冯琳女士代行合规总监的议案》。

(11) 2015年8月10日,公司召开临时董事会会议,会议审议通过了《关于变更融资类业务坏账准备计提标准的议案》。

(12) 2015年8月26日,公司召开第二届董事会第六次会议,会

议审议通过了如下决议：《关于公司首次公开发行股票并上市后三年内稳定股价预案的议案》、《公司利润分配政策及上市后分红规划方案》、《关于招股说明书等事宜的承诺及约束措施的议案》、《关于修订<董事会风险管理委员会议事规则>的议案》、《关于修订<董事会薪酬与提名委员会议事规则>的议案》、《关于更换公司第二届董事会薪酬与提名委员会委员及召集人的议案》、《关于修订<董事会议事规则>的议案》、《关于修订<公司章程>的议案》、《关于修订<股东大会议事规则>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司董事会秘书工作细则>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司独立董事制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司对外担保管理制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司对外投资管理制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司关联交易管理制度>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司总裁工作细则>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<董事会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<公司章程（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<股东大会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司董事会秘书工作细则（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司对外担保管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司对外投资管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公

司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司关联交易管理制度（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司募集资金管理办法（草案）>的议案》、《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<天风证券股份有限公司信息披露事务管理制度（草案）>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司会计政策>的议案》、《关于审议批准公司最近三年及一期审计报告的议案》、《关于审议批准公司内控鉴证报告的议案》、《关于公司 2015 年半年度合规报告的议案》、《关于公司 2015 年半年度风险控制指标监控报告的议案》、《关于指定财务总监冯琳女士代行公司首席风险官的议案》、《关于确认张军先生等高级管理人员职务及任职期限的议案》、《通过关于发行天风证券 2015 年次级债券的议案》、《通过关于提请股东大会授权非公开发行次级债券相关事宜的议案》。

（13）2015 年 9 月 1 日，公司召开临时董事会会议，会议审议通过了《关于提请审议公司出资投资权益类证券并相应调整公司一级风险限额指标的议案》。

（14）2015 年 9 月 29 日，公司召开第二届董事会第七次会议，会议审议通过了如下决议：《关于公司组织架构调整的议案》、《关于审核确认公司最近三年及一期关联交易事项的议案》、《关于向中国建设银行股份有限公司成都铁道支行申请增调给予公司国内金融机构人民币结算账户透支额度、开展债券投资业务及维持股票质押贷款业务的议案》、《关于成立固定收益子公司并调整注册资本的议案》、

《关于变更公司经营范围的议案》、《关于修改公司章程的议案》、《关于申请授权公司执行委员会根据监管部门批复意见经办调整固定收益子公司设立事宜、变更公司营业范围及修订<公司章程>的议案》。

(15) 2015年10月30日,公司召开第二届董事会第八次会议,会议审议通过了《关于拟聘任洪琳女士为公司合规总监的议案》。

(16) 2015年12月10日,公司召开第二届董事会第九次会议,会议审议通过了如下决议:《关于公司组织架构调整的议案》、《关于修订<合规管理基本规定>的议案》、《关于修订公司融资融券业务相关制度的议案》、《关于开展贵金属现货合约代理业务和黄金现货合约自营业务的议案》、《关于拟聘任肖函女士为公司首席风险官的议案》、《关于参与公开摘牌受让华泰保险股权的议案》。

3、监事会会议情况

(1) 2015年3月12日,公司召开第一届监事会第八次会议,会议审议通过了如下议案及报告:《关于公司2014年度监事会工作报告》、《公司年度报告(二〇一四年度)》、《公司2014年度财务决算报告》、《公司2015年度财务预算报告》、《公司2014年合规报告》、《公司2014年风险管理年报》、《关于公司调整公司一级风险限额指标的议案》、《关于公司第一届监事会非职工监事换届选举的议案》。

(2) 2015年8月3日,公司召开第二届监事会第一次会议,会议审议通过了《关于选举潘思纯先生为公司第二届监事会监事长的议案》。

(3) 2015年8月26日,公司召开第二届监事会第二次会议,会

议审议通过了如下议案：《关于制定公司首次公开发行股票并上市后适用的<监事会议事规则（草案）>的议案》、《关于制定<天风证券股份有限公司会计政策>的议案》、《关于审议批准公司最近三年及一期审计报告的议案》。

（4）2015年9月29日，公司召开第二届监事会第三次会议，会议审议通过了《关于审核确认公司最近三年及一期关联交易事项的议案》。

二、报告期内董事、监事的履职情况

1、报告期内董事会会议出席情况

姓名	职务	应出席次数	现场出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自出席会议	投票表决情况
余磊	董事长	16	0	16	0	0	否	均同意
张军	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
张小东	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
杜越新	董事	16	0	16	0	0	否	除一项议案弃权外，其他均同意
黄其龙	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
艾娇	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
王含冰	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
雷迎春	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
付扬	董事	16	0	16	0	0	否	均同意
陆德明	独立董事	16	0	16	0	0	否	均同意
黄孝武	独立董事	11	0	11	0	0	否	均同意
宁立志	独立董事	11	0	11	0	0	否	均同意
陈波	独立董事	10	0	10	0	0	否	均同意
潘敏	独立董事	9	0	9	0	0	否	均同意
崔忠泽	独立董事	4	0	4	0	0	否	均同意

2、报告期内监事会会议出席情况

姓名	职务	应出席次数	现场出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自出席会议	投票表决情况
潘思纯	监事长	3	0	3	0	0	否	均同意
范晓玲	监事	4	0	4	0	0	否	均同意
郭岭	监事	4	0	4	0	0	否	均同意
戚耕耘	监事	4	0	4	0	0	否	均同意
何建国	监事长	1	0	1	0	0	否	均同意

3、报告期内独立董事履职情况和对公司有关事项提出异议的情况

(1) 履职情况

报告期内，公司独立董事独立履行职责，共参加董事会会议 16 次，无缺席情况，并严格按照《公司法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则（试行）》以及《公司章程》等相关规定，忠实履行职责，及时了解公司经营信息，全面关注公司发展，并积极对公司经营治理提出改进建议，对审议事项进行独立判断，充分发挥了独立董事作用，维护了公司及公司股东、客户的合法权益。

(2) 对公司有关事项提出异议的情况

报告期内，独立董事对公司有关事项未提出异议。

三、报告期内董事会下设专门委员会履职情况

报告期内，公司共组织召开 4 次董事会专门委员会会议，其中风险管理委员会召开会议 1 次、审计委员会召开会议 1 次、薪酬与提名委员会召开会议 2 次，充分发挥了董事会专门委员会作用，提高了董事会议事效率和决策质量。

1、风险管理委员会：

2015 年 3 月 10 日，公司在会议室召开第一届风险管理委员会第四

次会议。会议经审议形成如下决议：

(1) 审议通过《关于公司 2014 年风险管理年报》

(2) 审议通过《关于公司 2014 年年度合规报告》

会议要求加强对公司净资产等各项风险控制指标的实时监控，进一步建立健全净资产补足机制，保证公司的净资产等风控指标持续符合监管部门的要求。

2、审计委员会：

2015 年 3 月 10 日，公司在会议室召开第一届审计委员会委员会第四次会议。会议经审议形成如下决议：

(1) 审议通过《关于续聘会计师事务所的议案》

经审查，同意续聘大信会计师事务所为公司 2015 年度审计机构。

(2) 审议通过《关于公司 2014 年年度报告》

会议通过《关于公司 2014 年年度报告》，并要求公司按照监管规定做好年度报告的报送和披露工作。

3、薪酬与提名委员会

(1) 2015 年 10 月 30 日，公司在会议室召开第二届薪酬与提名委员会第一次会议。会议审议通过了《关于拟聘任公司合规总监的议案》，同意将洪琳女士作为公司合规总监候选人提交公司董事会审议。

(2) 2015 年 12 月 10 日，公司在会议室召开第二届薪酬与提名委员会第二次会议。会议审议通过了《关于拟聘任肖函女士为公司首席风险官的议案》，同意将肖函女士作为公司首席风险官候选人提交公司董事会审议。

四、公司合规管理体系建设情况

2015年，公司业务发展及创新继续保持加快的节奏，业务规模不断扩大，同时积极应对“加强监管”的外部环境，有效履行制度建设、政策研究、合规审查与咨询、合规检查、合规培训、合规评估、合规报告、反洗钱、信息隔离墙管理等各项合规管理职责，顺利完成了预定的合规管理工作目标，保障公司各业务健康平稳运行、规范开展。

第一，不断深入对各项业务的精细化合规管理工作，有效保障公司全年未发生重大监管风险；

第二，圆满完成了合规审查、合规报告、合规监测、信息隔离墙管理、合规管理有效性评估和反洗钱管理等工作；

第三，强化并有针对性的开展合规检查工作，结合外部监管要求及公司实际，组织或参与了针对多项业务、相关部门或子公司的专项检查工作，并积极配合湖北证监局对公司的现场检查工作，根据检查结果建立了整改事项定期跟踪机制，及时跟进和落实各项整改要求，确保各业务规范开展；

第四，有序开展法律事务工作，及时推送政策监管动态，确保各项政策得以学习并落实；

第五，开展多种形式的合规培训工作，致力合规文化建设。

五、稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

2015年公司稽核部门分别对包括武汉八一路证券营业部在内的8家证券营业部实施了现场常规例行稽核、通过现场与非现场相结合方式对公司34家分支机构反洗钱工作实施了专项稽核、对包括新三板在

内的重点业务实施了专项稽核、对公司流动性风险管理等实施了专项稽核、按照相关监管及公司制度要求对公司主要岗位负责人在岗或离岗经济责任审计 20 人次。各项稽核工作的开展确保了公司各项业务合规运行。

第七章 内部控制

一、公司内部控制制度建设情况

公司按照企业内部控制规范体系的规定，已经建立了较为完善合理的内部控制制度体系，覆盖公司所有部门、分支机构和全体员工，并贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节，确保公司各项业务在合法、合规的前提下稳健发展。该制度体系在经营管理活动中得到了一贯、严格的执行，并发挥了积极作用。公司内部控制的目的是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进发展战略的实现。公司将内部控制建设始终贯穿于公司的经营发展之中，形成了内部控制制度建设的长效机制。2015年，公司各部门和分支机构对现有的各项内部控制制度进行了梳理和优化，并根据业务发展需要及时地制定了新的内部控制制度，在日常工作中开展了全面有效的内部控制。与此同时，公司稽核审计部根据国家法律法规和公司制度的规定，结合公司发展战略，对公司各部门和分支机构经营管理活动和内部控制的健全性和有效性进行了审计监督，确保公司内部控制制度健全、执行有效，保证了公司经营管理的正常进行。

二、董事会关于内部控制责任的声明

报告期内，董事会严格依据《企业内部控制基本规范》等法律法规的规定，要求公司逐步推进内部控制各项工作，负责内部控制的建立健全和有效实施。董事会及经营管理层结合公司实际情况，对战略目标、经营管理的效率和效果目标、财务报告及相关信息真实完整目标、资产

安全目标、合法合规目标等单个或整体控制目标的实现进行评价，认为本报告期内，未发现公司存在内部控制设计或执行方面的重大缺陷。公司内部控制制度健全，执行有效。

第八章 财务报告

一、 审计意见

公司本年度财务报告已经大信会计师事务所（特殊普通合伙）中国注册会计师郭晗、向辉审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。

二、 会计报表及附注（附后）

天风证券股份有限公司
审 计 报 告

大信审字[2016]第 2-00126 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.





大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
DisBeijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

审 计 报 告

大信审字[2016]第 2-00126 号

天风证券股份有限公司全体股东：

我们审计了后附的天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2015 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表，以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是贵公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
DisBeijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

三、 审计意见

我们认为，贵公司财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了贵公司 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和现金流量。

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一六年二月二十四日

券股份合并资产负债表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注	期末余额	期初余额
资 产：			
货币资金	五、（一）	5,396,580,045.81	2,014,332,925.09
其中：客户存款		2,763,315,929.97	1,506,047,888.85
结算备付金	五、（二）	1,806,252,505.37	916,739,925.38
其中：客户备付金		1,274,756,757.63	845,540,898.21
拆出资金		-	-
融出资金	五、（三）	1,620,399,012.30	1,348,829,290.40
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	五、（四）	8,740,190,905.94	2,917,366,787.95
衍生金融资产	五、（五）	1,995,954.13	4,049,710.31
买入返售金融资产	五、（六）	8,621,850,005.24	5,382,301,084.98
应收款项		25,909,324.82	6,965,809.76
应收利息	五、（五）	130,839,828.63	31,401,533.09
存出保证金	五、（八）	981,386,140.75	520,841,582.48
划分为持有待售的资产	五、（九）	24,965,476.16	73,209,211.16
可供出售金融资产	五、（十）	7,571,024,639.23	1,061,138,084.47
持有至到期投资		-	-
长期股权投资	五、（十一）	1,145,204,910.31	57,806,445.49
投资性房地产	五、（十二）	104,895,540.82	98,310,694.34
固定资产	五、（十三）	153,213,383.38	97,127,894.56
在建工程		66,861,271.53	-
无形资产	五、（十四）	80,148,128.27	60,269,289.89
商誉	五、（十五）	17,591,963.99	15,552,244.53
递延所得税资产	五、（十六）	12,230,485.87	3,643,336.31
其他资产	五、（十八）	2,010,183,039.52	1,443,062,446.55
资产总计		38,511,722,562.07	16,052,948,296.74

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



合并资产负债表(续)

编制单位: 天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位: 人民币元

项 目	附注	期末余额	期初余额
负 债:			
短期借款		-	-
应付短期融资款	五、(十九)	1,939,980,000.00	31,081,164.33
拆入资金	五、(二十)	167,000,000.00	513,206,986.75
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	五、(二十一)	-	308,892,200.00
衍生金融负债	五、(五)	-	-
卖出回购金融资产款	五、(二十二)	10,706,465,464.75	6,821,508,481.16
代理买卖证券款	五、(二十三)	4,172,539,308.28	2,620,815,928.27
代理承销证券款		-	-
应付职工薪酬	五、(二十四)	563,954,290.33	64,748,077.27
应交税费	五、(二十五)	297,204,173.59	70,356,502.84
应付款项	五、(二十六)	39,376,953.92	59,670,335.62
应付利息	五、(二十五)	220,084,462.86	62,905,478.30
预计负债		-	-
长期借款		-	-
应付债券	五、(二十八)	5,735,611,520.88	1,346,425,600.00
递延所得税负债	五、(十六)	122,700,242.62	29,083,818.03
其他负债	五、(二十九)	1,573,110,340.58	376,325,525.24
负债合计		25,538,026,757.81	12,305,020,097.81
所有者权益:			
股本	五、(三十)	4,662,000,000.00	2,341,130,000.00
其他权益工具			
资本公积	五、(三十一)	3,046,803,521.68	263,286,255.43
减: 库存股		-	-
其他综合收益	五、(三十二)	210,246,663.93	39,623,852.96
盈余公积	五、(三十三)	114,800,777.37	32,981,563.43
一般风险准备	五、(三十四)	245,614,043.68	81,975,615.80
未分配利润	五、(三十五)	905,427,157.16	213,298,385.33
归属于母公司股东权益合计		9,184,892,163.82	2,972,295,672.95
少数股东权益		3,788,803,640.44	775,632,525.98
所有者权益合计		12,973,695,804.26	3,747,928,198.93
负债和所有者权益总计		38,511,722,562.07	16,052,948,296.74

法定代表人:

主管会计工作负责人:

会计机构负责人:

余磊

张军

冯琳





母公司资产负债表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

	附注	期末余额	期初余额
资 产：			
货币资金		4,475,425,900.88	1,268,778,929.94
其中：客户存款		2,320,623,163.65	1,043,567,551.68
结算备付金		1,886,856,386.37	916,739,925.38
其中：客户备付金		1,274,756,757.63	845,540,898.21
拆出资金		-	-
融出资金		1,620,399,012.30	1,348,829,290.40
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		7,621,255,993.65	2,914,535,187.95
衍生金融资产		1,995,954.13	4,049,710.31
买入返售金融资产		8,613,532,922.07	5,382,301,084.98
应收款项		3,355,134.51	5,987,309.76
应收利息		114,494,750.61	22,904,416.08
存出保证金		280,438,309.63	76,484,130.73
划分为持有待售的资产		-	51,243,735.00
可供出售金融资产		4,351,496,269.60	700,770,606.79
持有至到期投资		55,000,000.00	-
长期股权投资	十四、（一）	1,892,313,264.57	503,165,476.16
投资性房地产		20,130,091.72	98,310,694.34
固定资产		87,520,736.92	92,235,750.72
在建工程		17,470,930.53	-
无形资产		66,026,215.68	53,446,529.63
递延所得税资产		6,215,404.94	3,643,336.31
其他资产		957,581,285.95	1,124,295,923.95
资产总计		32,071,508,564.06	14,567,722,038.43

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：





母公司资产负债表(续)

编制单位: 天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位: 人民币元

项目	附注	期末余额	期初余额
负 债:			
短期借款		-	-
应付短期融资款		1,939,980,000.00	31,081,164.33
拆入资金		167,000,000.00	513,206,986.75
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		-	308,892,200.00
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		10,706,465,464.75	7,201,508,481.16
代理买卖证券款		3,274,801,069.25	1,819,979,140.28
代理承销证券款		-	-
应付职工薪酬		519,691,173.38	61,044,753.82
应交税费		258,106,626.57	57,525,234.77
应付款项		-	16,321,045.32
应付利息		209,185,187.80	62,011,500.58
预计负债		-	-
长期借款		-	-
应付债券		5,735,611,520.88	1,346,425,600.00
递延所得税负债		121,600,541.63	29,083,818.03
其他负债		89,243,769.73	119,730,721.37
负债合计		23,021,685,353.99	11,566,810,646.41
所有者权益:			
股本		4,662,000,000.00	2,341,130,000.00
其他权益工具		-	-
资本公积		3,093,587,862.35	302,943,862.35
减: 库存股		-	-
其他综合收益		152,035,816.29	32,830,137.60
盈余公积		114,800,777.37	32,981,563.43
一般风险准备		245,614,043.68	81,975,615.80
未分配利润		781,784,710.38	209,050,212.84
所有者权益合计		9,049,823,210.07	3,000,911,392.02
负债和所有者权益总计		32,071,508,564.06	14,567,722,038.43

法定代表人:

主管会计工作负责人:

会计机构负责人:



合并利润表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年度

单位：人民币元

项 目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		3,223,839,119.72	1,112,169,600.14
手续费及佣金净收入	五、(三十六)	1,576,084,339.74	650,629,056.53
其中：经纪业务手续费净收入		566,822,629.34	224,189,235.54
投资银行业务手续费净收入		614,920,857.83	180,002,637.15
资产管理业务手续费净收入		164,580,314.71	44,760,938.57
利息净收入	五、(三十五)	71,225,592.59	81,735,727.92
投资收益（损失以“-”号填列）	五、(三十八)	1,300,343,358.56	289,743,370.64
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		18,470,947.71	-1,693,554.51
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	五、(三十九)	267,908,395.75	84,480,723.57
汇兑收益（损失以“-”号填列）		607,603.40	50,537.48
其他业务收入	五、(四十)	7,669,829.68	5,530,184.00
二、营业支出		1,941,767,808.92	833,188,722.61
营业税金及附加	五、(四十一)	170,652,659.02	58,373,933.39
业务及管理费	五、(四十二)	1,728,109,830.77	764,093,104.74
资产减值损失	五、(四十三)	39,229,067.85	7,296,489.08
其他业务成本		3,776,251.28	3,425,195.40
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,282,071,310.80	278,980,877.53
加：营业外收入	五、(四十四)	8,005,305.66	2,960,906.45
减：营业外支出	五、(四十五)	12,773,065.45	1,542,482.35
四、利润总额（亏损以“-”号填列）		1,277,303,551.01	280,399,301.63
减：所得税费用	五、(四十六)	276,129,183.14	64,297,060.69
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,001,174,367.87	216,102,240.94
其中：归属于母公司股东的净利润		937,586,413.65	207,746,164.65
少数股东损益		63,587,954.22	8,356,076.29
六、其他综合收益的税后净额		278,093,295.65	58,432,642.33
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		170,622,810.97	58,427,561.97
以后将重分类进损益的其他综合收益		170,622,810.97	58,427,561.97
(1) 权益法核算的在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额		2,951,922.68	
(2) 可供出售金融资产公允价值变动损益		167,670,888.29	58,427,561.97
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		107,470,484.68	5,080.36
五、综合收益总额		1,279,267,663.52	274,534,883.27
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		1,108,209,224.62	266,173,726.62
(二) 归属于少数股东的综合收益总额		171,058,438.90	8,361,156.65
八、每股收益			
(一) 基本每股收益(元/股)	十五	0.239	0.104
(二) 稀释每股收益(元/股)	十五	0.239	0.104

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



母公司利润表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年度

单位：人民币元

项 目	附注	本期发生额	上期发生额
一、营业收入		2,651,817,629.48	858,552,103.43
手续费及佣金净收入	十四、(二)	1,278,516,336.31	416,733,316.79
其中：经纪业务手续费净收入		519,757,047.26	161,777,128.94
投资银行业务手续费净收入		599,931,519.63	171,686,283.33
资产管理业务手续费净收入		110,955,213.09	44,760,938.57
利息净收入	十四、(三)	-49,056,367.60	29,117,584.07
投资收益（损失以“-”号填列）	十四、(四)	1,207,704,537.89	322,733,327.52
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		13,753,326.17	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	十四、(五)	212,394,019.48	84,387,153.57
汇兑收益（损失以“-”号填列）		607,603.40	50,537.48
其他业务收入		1,651,500.00	5,530,184.00
二、营业支出		1,586,476,460.69	598,421,599.19
营业税金及附加		146,415,208.53	43,215,777.86
业务及管理费		1,423,437,013.79	547,209,239.73
资产减值损失		15,135,037.99	4,571,386.20
其他业务成本		1,489,200.38	3,425,195.40
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,065,341,168.79	260,130,504.24
加：营业外收入		3,454,622.37	1,667,620.70
减：营业外支出		12,331,788.91	1,529,455.90
四、利润总额（亏损以“-”号填列）		1,056,464,002.25	260,268,669.04
减：所得税费用		238,271,862.89	53,950,387.45
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		818,192,139.36	206,318,281.59
六、其他综合收益的税后净额		119,205,678.69	51,727,382.70
(一)以后将重分类进损益的其他综合收益		119,205,678.69	51,727,382.70
(1)权益法核算的在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额		2,930,893.24	
(2)可供出售金融资产公允价值变动损益		116,274,785.45	51,727,382.70
七、综合收益总额		937,397,818.05	258,045,664.29

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：





合并现金流量表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年度

单位：人民币元

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：			
处置交易性金融资产净增加额		-4,828,392,853.26	-1,824,093,204.96
收取利息、手续费及佣金的现金		2,325,763,273.54	849,308,645.62
拆入资金净增加额		-346,206,986.75	356,000,000.00
回购业务资金净增加额		635,696,602.16	1,516,384,040.12
融出资金净减少额			
代理买卖证券收到的现金净额		156,833,799,791.77	30,280,168,454.36
收到其他与经营活动有关的现金	五、（四十七）	2,273,724,041.52	378,933,291.07
经营活动现金流入小计		156,894,383,868.98	31,556,701,226.21
融出资金净增加额		276,445,546.42	1,041,487,764.23
代理买卖证券支付的现金净额		155,500,009,226.86	29,086,387,046.79
支付利息、手续费及佣金的现金		601,201,206.96	213,372,547.45
支付给职工以及为职工支付的现金		589,280,751.52	280,786,916.88
支付的各项税费		181,641,858.76	94,596,287.29
支付其他与经营活动有关的现金	五、（四十七）	1,966,148,268.29	1,857,067,539.06
经营活动现金流出小计		159,114,726,858.81	32,573,698,101.70
经营活动产生的现金流量净额		-2,220,342,989.83	-1,016,996,875.49
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		2,381,621,274.09	457,243,584.67
取得投资收益收到的现金		106,375,927.53	191,386,333.16
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	10,400.00
收到其他与投资活动有关的现金		14,000,000.00	42,000,000.00
投资活动现金流入小计		2,501,997,201.62	690,640,317.83
投资支付的现金		9,553,564,766.29	1,430,288,859.21
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		268,059,809.46	63,496,851.42
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		8,804,991.46	-
支付其他与投资活动有关的现金		193,659,891.85	-
投资活动现金流出小计		10,024,089,459.06	1,493,785,710.63
投资活动产生的现金流量净额		-7,522,092,257.44	-803,145,392.80
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		7,951,291,649.79	1,408,020,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		2,845,377,649.79	508,020,000.00
取得借款收到的现金		4,226,726,575.00	
发行债券收到的现金		3,823,200,000.00	1,346,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金		-	338,660,478.31
筹资活动现金流入小计		16,001,218,224.79	3,092,680,478.31
偿还债务支付的现金		1,767,826,575.00	-
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		210,956,265.21	7,544,752.04
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		9,242,573.33	-
支付其他与筹资活动有关的现金		8,848,040.00	12,125,000.00
筹资活动现金流出小计		1,987,630,880.21	19,669,752.04
筹资活动产生的现金流量净额		14,013,587,344.58	3,073,010,726.27
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		607,603.40	50,537.48
五、现金及现金等价物净增加额		4,271,759,700.71	1,252,918,995.46
加：年初现金及现金等价物余额		2,931,072,850.47	1,678,153,855.01
六、期末现金及现金等价物余额		7,202,832,551.18	2,931,072,850.47

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



母公司现金流量表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年度

单位：人民币元

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：			
处置交易性金融资产净增加额		-4,017,291,509.47	-1,822,093,204.96
收取利息、手续费及佣金的现金		1,961,238,373.51	664,814,845.14
拆入资金净增加额		-346,206,986.75	356,000,000.00
回购业务资金净增加额		264,013,685.33	1,516,384,040.12
融出资金净减少额		-	-
代理买卖证券收到的现金净额		156,393,831,151.83	29,547,008,888.88
收到其他与经营活动有关的现金		356,105,716.18	50,189,045.72
经营活动现金流入小计		154,611,690,430.63	30,312,303,614.90
融出资金净增加额		276,445,546.42	1,041,487,764.23
代理买卖证券支付的现金净额		154,939,009,222.86	28,451,899,175.29
支付利息、手续费及佣金的现金		554,640,937.91	178,785,840.92
支付给职工以及为职工支付的现金		533,353,154.33	253,011,162.40
支付的各项税费		137,602,795.11	72,390,334.25
支付其他与经营活动有关的现金		687,405,666.22	850,451,746.29
经营活动现金流出小计		157,128,457,322.85	30,848,026,023.38
经营活动产生的现金流量净额		-2,516,766,892.22	-535,722,408.48
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,905,835,590.47	49,542,260.14
取得投资收益收到的现金		85,818,595.37	165,258,818.31
收到其他与投资活动有关的现金		-	42,000,000.00
投资活动现金流入小计		1,991,654,185.84	256,801,078.45
投资支付的现金		6,427,729,730.22	1,071,672,769.15
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		72,844,125.99	59,126,753.08
支付其他与投资活动有关的现金		-	-
投资活动现金流出小计		6,500,573,856.21	1,130,799,522.23
投资活动产生的现金流量净额		-4,508,919,670.37	-873,998,443.78
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		5,105,914,000.00	900,000,000.00
取得借款收到的现金		4,226,726,575.00	-
发行债券收到的现金		3,823,200,000.00	1,346,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金		-	338,660,478.31
筹资活动现金流入小计		13,155,840,575.00	2,584,660,478.31
偿还债务支付的现金		1,767,826,575.00	-
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		177,323,568.88	-
支付其他与筹资活动有关的现金		8,848,040.00	12,125,000.00
筹资活动现金流出小计		1,953,998,183.88	12,125,000.00
筹资活动产生的现金流量净额		11,201,842,391.12	2,572,535,478.31
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		607,603.40	50,537.48
五、现金及现金等价物净增加额		4,176,763,431.93	1,162,865,163.53
加：年初现金及现金等价物余额		2,185,518,855.32	1,022,653,691.79
六、期末现金及现金等价物余额		6,362,282,287.25	2,185,518,855.32

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



合并所有者权益变动表

2015年度

单位：人民币元

项 目	本期										
	股本	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他	归属于母公司股东的 所有者权益合计	少数股东权益	所有者权益合计
一、上年年末余额	2,341,130,000.00	263,286,255.43		39,623,852.96	32,981,563.43	81,975,615.80	213,298,385.33		2,972,295,672.95	775,632,525.98	3,747,928,198.93
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	2,341,130,000.00	263,286,255.43		39,623,852.96	32,981,563.43	81,975,615.80	213,298,385.33		2,972,295,672.95	775,632,525.98	3,747,928,198.93
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	2,420,870,000.00	2,783,517,266.25		170,622,810.97	81,819,213.94	163,638,427.88	692,128,771.83		6,212,596,490.87	3,013,171,114.46	9,225,767,605.33
（一）综合收益总额				170,622,810.97			937,586,413.65		1,108,209,224.62	63,587,954.22	1,171,797,178.84
（二）所有者投入和减少资本	2,320,870,000.00	2,783,517,266.25							5,104,387,266.25	2,937,560,586.91	8,041,947,853.16
1.所有者投入资本	2,320,870,000.00	2,785,044,000.00							5,105,914,000.00	2,845,377,649.79	7,951,291,649.79
2.股份支付计入所有者权益的金额											
3.其他权益工具持有者投入资本											
4.其他											
（三）利润分配		-1,526,733.75							-1,526,733.75	92,182,937.12	90,656,203.37
1.提取盈余公积					81,819,213.94	163,638,427.88	-245,457,641.82			12,022,573.33	12,022,573.33
2.提取一般风险准备					81,819,213.94		-81,819,213.94				
3.对所有者分配							-163,638,427.88				
4.其他											
（四）所有者权益内部结转											
1.资本公积转增资本											
2.盈余公积转增资本											
3.盈余公积弥补亏损											
4.结转重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动											
5.其他											
四、本期末余额	4,662,000,000.00	3,046,803,521.68		210,246,663.93	114,800,777.37	245,614,043.68	905,427,157.16		9,184,892,163.82	3,788,803,640.44	12,973,695,804.26

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：

余磊

张军

冯琳





合并所有者权益变动表

2015年度

单位：人民币元

项	上期											
	股本	其他权益工具	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	其他	归属于母公司股东的 所有者权益合计	少数股东权益	所有者权益合计
一、上年年末余额	1,741,130,000.00		253,024.86		-18,803,709.01	12,349,735.27	40,711,959.48	67,447,705.16		1,843,068,715.76	377,357,987.45	2,220,446,703.21
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年初余额	1,741,130,000.00		253,024.86		-18,803,709.01	12,349,735.27	40,711,959.48	67,447,705.16		1,843,068,715.76	377,357,987.45	2,220,446,703.21
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	600,000,000.00		263,033,230.57		58,427,561.97	20,631,828.16	41,263,656.32	145,850,680.17		1,129,206,957.19	398,274,538.53	1,527,481,495.72
（一）综合收益总额					58,427,561.97			207,746,164.65		266,173,726.62	8,356,076.29	274,529,802.91
（二）所有者投入和减少资本	600,000,000.00		263,033,230.57							863,033,230.57	389,938,101.80	1,252,971,332.37
1.所有者投入资本	600,000,000.00		300,000,000.00							900,000,000.00	508,020,000.00	1,408,020,000.00
2.股份支付计入所有者权益的金额												
3.其他权益工具持有者投入资本												
4.其他			-36,966,769.43							-36,966,769.43	-118,081,898.20	-155,048,667.63
（三）利润分配						20,631,828.16	41,263,656.32	-61,895,484.48			-19,639.56	-19,639.56
1.提取盈余公积						20,631,828.16		-20,631,828.16				
2.提取一般风险准备							41,263,656.32	-41,263,656.32				
3.对所有者分配的分配												
4.其他												
（四）所有者权益内部结转												
1.资本公积转增资本												
2.盈余公积转增资本												
3.盈余公积弥补亏损												
4.结转重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动												
5.其他												
四、本期末余额	2,341,130,000.00		263,296,255.43		39,623,852.96	32,981,563.43	81,975,615.80	213,298,385.33		2,972,295,672.95	775,632,525.98	3,747,928,198.93

法定代表人：

会计机构负责人：

张印军

余磊

冯琳

母公司所有者权益变动表

2015年度

单位：人民币元

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	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计	
一、上年年末余额	2,341,130,000.00		302,943,862.35		32,830,137.60	32,981,563.43	81,975,615.80	209,050,212.84	3,000,911,392.02	
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年初余额	2,341,130,000.00		302,943,862.35		32,830,137.60	32,981,563.43	81,975,615.80	209,050,212.84	3,000,911,392.02	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	2,320,870,000.00		2,790,644,000.00		119,205,678.69	81,819,213.94	163,638,427.88	572,734,497.54	6,048,911,818.05	
（一）综合收益总额					119,205,678.69			818,192,139.36	937,397,818.05	
（二）所有者投入和减少资本	2,320,870,000.00		2,790,644,000.00						5,111,514,000.00	
1.所有者投入资本	2,320,870,000.00		2,785,044,000.00						5,105,914,000.00	
2.股份支付计入所有者权益的金额										
3.其他权益工具持有者投入资本										
4.其他			5,600,000.00							
（四）利润分配										
1.提取盈余公积						81,819,213.94	163,638,427.88	-245,457,641.82		
2.提取一般风险准备						81,819,213.94		-81,819,213.94		
3.对所有者的分配							163,638,427.88	-163,638,427.88		
4.其他										
（五）所有者权益内部结转										
1.资本公积转增资本										
2.盈余公积转增资本										
3.盈余公积弥补亏损										
4.结转重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动										
5.其他										
四、本期末余额	4,662,000,000.00		3,093,587,862.35		152,035,816.29	114,800,777.37	245,614,043.68	781,784,710.38	9,049,823,210.07	

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



母公司所有者权益变动表

2015年度

单位：人民币元

项	上期								
	股本	其他权益工具	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年年末余额	741,140,000.00		2,943,862.35		-18,897,245.10	12,349,735.27	40,711,959.48	64,627,415.73	1,842,865,727.73
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	1,741,130,000.00		2,943,862.35		-18,897,245.10	12,349,735.27	40,711,959.48	64,627,415.73	1,842,865,727.73
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	600,000,000.00		300,000,000.00		51,727,382.70	20,631,828.16	41,263,656.32	144,422,797.11	1,158,045,664.29
（一）综合收益总额					51,727,382.70			206,318,281.59	258,045,664.29
（二）所有者投入和减少资本	600,000,000.00		300,000,000.00						900,000,000.00
1. 所有者投入资本	600,000,000.00		300,000,000.00						900,000,000.00
2. 股份支付计入所有者权益的金额									
3. 其他权益工具持有者投入资本									
4. 其他									
（三）利润分配									
1. 提取盈余公积						20,631,828.16	41,263,656.32	-61,895,484.48	
2. 提取一般风险准备						20,631,828.16		-20,631,828.16	
3. 对所有者的分配								-41,263,656.32	
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转									
1. 资本公积转增资本									
2. 盈余公积转增资本									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 结转重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动									
5. 其他									
四、本期期末余额	2,341,130,000.00		302,943,862.35		32,830,137.60	32,981,563.43	81,975,615.80	209,050,212.84	3,000,911,392.02

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：

余磊

张军

冯琳

天风证券股份有限公司 财务报表附注

(除特别注明外，本附注金额单位均为人民币元)

一、公司基本情况

1、历史沿革

天风证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）原名四川省天风证券经纪有限责任公司，系由四川省国有资产经营投资管理有限责任公司、四川省嘉鑫投资股份有限公司、四川汉龙（集团）有限公司、四川宏达（集团）有限公司、四川亚华企业（集团）有限公司共同出资组建，于2000年3月29日取得四川省工商行政管理局核发的5100001812199号《企业法人营业执照》，原注册资本为人民币7,700万元。该次出资业经四川君和会计师事务所出具的君和验内字（1999）第006号验资报告验证。

2004年4月，公司更名为天风证券有限责任公司，并办理了工商变更登记手续。2008年公司注册地址迁至湖北省武汉市，于2008年2月27日取得武汉市工商行政管理局核发的420100000055793号《企业法人营业执照》。

2012年2月14日，根据公司2011年第四次临时股东会决议及修改后的章程规定，并经中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》（证监许可[2012]96号）核准，公司各股东以公司截至2011年08月31日止经审计的净资产1,098,812,451.31元中的837,000,000.00元，按照1:1的比例，折成天风证券股份有限公司股份837,000,000股，每股面值1元。净资产超过拟设立的股份有限公司注册资本部分（261,812,451.31元），分别计入一般风险准备8,006,244.48元、交易风险准备8,006,244.48元、资本公积245,799,962.35元。该改制验资业经大信会计师事务所有限公司审验并出具大信验字[2012]第2-0007号验资报告验证。

公司地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

法人代表：余磊

注册资本：人民币肆拾陆亿陆仟贰佰万元整

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；证券投资基金代销；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；代销金融产品（凭



许可证在核定范围内及期限内经营)；为期货公司提供中间介绍业务。(上述经营范围中国家有专项规定的项目经审批后或凭许可证在核定范围内与期限内经营)。

2、公司对营业部实行了统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算。

报告期公司已获取许可证的营业部及分公司情况如下：

序号	营业部名称	注册地址	成立日期	营运资金	许可证号
1	武汉八一路证券营业部	湖北武汉	2009年12月21日	5,000,000.00	10781002
2	成都高华横街证券营业部(原名:成都武侯祠大街证券营业部)	四川成都	2002年12月20日	5,000,000.00	10781010
3	新津武阳中路证券营业部	四川新津	2002年12月14日	5,000,000.00	10781008
4	资阳西门桥街证券营业部	四川资阳	2006年2月13日	5,000,000.00	10781009
5	成都市一环路东五段证券营业部(原名:成都走马街证券营业部)	四川成都	2000年3月30日	5,000,000.00	10781001
6	什邡蓥峰北路证券营业部	四川什邡	2001年11月15日	5,000,000.00	10781011
7	江油金轮干道证券营业部	四川江油	2002年3月29日	5,000,000.00	10781012
8	大连中山路证券营业部	辽宁大连	2001年12月26日	5,000,000.00	10781005
9	大连天河路证券营业部	辽宁大连	1992年10月9日	5,000,000.00	10781004
10	大连普兰店体育路证券营业部	辽宁大连	2001年12月18日	5,000,000.00	10781006
11	深圳滨河路证券营业部	广东深圳	1995年9月29日	5,000,000.00	10781003
12	南京建邺路证券营业部	江苏南京	2008年9月19日	5,000,000.00	10781007
13	襄阳长征路证券营业部	湖北襄阳	2013年6月6日	5,000,000.00	10781017
14	武汉佳园路证券营业部	湖北武汉	2013年5月31日	5,000,000.00	10781015
15	武汉唐家墩路证券营业部	湖北武汉	2013年6月4日	5,000,000.00	10781016
16	荆门军马场一路证券营业部	湖北荆门	2013年6月6日	5,000,000.00	10781014
17	京山轻机大道证券营业部	湖北京山	2013年6月6日	5,000,000.00	10781013
18	钟祥王府大道证券营业部	湖北钟祥	2013年6月5日	5,000,000.00	10781018
19	上海芳甸路证券营业部	上海	2014年3月12日		10781020
20	杭州教工路证券营业部	浙江杭州	2014年1月21日		10781021
21	北京佟麟阁证券营业部	北京	2014年4月23日		10781024
22	合肥阜南路证券营业部	安徽合肥	2014年4月8日		10781023
23	天门中惺路证券营业部	湖北天门	2014年5月12日		10781022
24	宣城自忠路证券营业部	湖北宣城	2014年9月2日		10781025
25	谷城振兴街证券营业部	湖北谷城	2014年9月3日		10781026
26	长沙韶山中路证券营业部	湖南长沙	2014年9月23日		10781027
27	广州华夏路证券营业部	广东广州	2014年10月8日		10781028
28	上海证券资产管理分公司	上海	2011年11月02日		Z19931F01
29	上海证券自营分公司	上海	2013年6月18日		Z19931F02



序号	营业部名称	注册地址	成立日期	营运资金	许可证号
30	北京证券承销分公司	北京	2011年11月02日		Z19911F01
31	四川分公司	四川成都	2012年11月07日		Z19951F01
32	安徽分公司	安徽合肥	2014年9月23日		10785005
33	上海国宾路证券营业部	上海	2015年3月20日		10781031
34	上海马当路证券营业部	上海	2015年4月21日		10781029
35	重庆沧白路证券营业部	重庆	2015年9月28日		10781033
36	襄阳东风汽车大道证券营业部	湖北襄阳	2015年8月17日		10781032
37	北京海淀长春桥证券营业部	北京	2015年8月25日		10781034
38	天津分公司	天津	2015年11月9日		10785006
39	上海漕溪北路证券营业部	上海	2015年11月27日		10781035
40	宜昌夷陵大道证券营业部	湖北宜昌	2015年12月30日		10781037

二、 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基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》和具体会计准则等规定（以下合称“企业会计准则”），并基于以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。

2、持续经营：本公司财务报表以持续经营为基础，自报告期末起 12 个月不存在对持续经营能力产生重大怀疑。

三、 重要会计政策和会计估计

（一）遵循企业会计准则的声明

本公司编制的财务报表符合《企业会计准则》的要求，真实、完整地反映了本公司 2015 年 12 月 31 日、2014 年 12 月 31 日的财务状况、2015 年度、2014 年度的经营成果和现金流量等相关信息。

（二）会计期间

本公司会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

（三）营业周期

本公司以一年 12 个月作为正常营业周期，并以营业周期作为资产和负债的流动性划分标准。

（四）记账本位币

本公司以人民币为记账本位币。



(五) 企业合并

1、同一控制下的企业合并

同一控制下企业合并形成的长期股权投资合并方以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，本公司在合并日按照所取得的被合并方在最终控制方合并财务报表中的净资产的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。合并方以发行权益性工具作为合并对价的，按发行股份的面值总额作为股本。长期股权投资的初始投资成本与合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，应当调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

2、非同一控制下的企业合并

对于非同一控制下的企业合并，合并成本为购买方在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值之和。非同一控制下企业合并中所取得的被购买方符合确认条件的可辨认资产、负债及或有负债，在购买日以公允价值计量。购买方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，体现为商誉价值。购买方对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，经复核后合并成本仍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，计入当期营业外收入。

(六) 合并财务报表的编制方法

1、投资主体的判断依据

本公司所包含的投资性主体，判断依据如下：

如果母公司是投资性主体，则母公司应当仅将为其投资活动提供相关服务的子公司（如有）纳入合并范围并编制合并财务报表；其他子公司不应当予以合并，母公司对其他子公司的投资应当按照公允价值计量且其变动计入当期损益。

如果母公司是投资性主体，且不存在为其投资活动提供相关服务的子公司，则不应当编制合并财务报表。

2、合并财务报表范围

本公司将全部子公司（包括本公司所控制的单独主体）纳入合并财务报表范围，包括被本公司控制的企业、被投资单位中可分割的部分以及结构化主体。

本公司在评估是否控制结构化主体时，需要考虑：（1）投资方对被投资方的权力；（2）参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；（3）有能力运用对被投资方的权力影响其回报的金额。



本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

- (1) 在设立被投资方时的决策及本公司的参与度；
- (2) 相关合同安排；
- (3) 仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；
- (4) 本公司对被投资方做出的承诺。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需考虑本公司之决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平、以及本公司因持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。

2、统一母子公司的会计政策、统一母子公司的资产负债表日及会计期间

子公司与本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，按照本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。

3、合并财务报表抵销事项

合并财务报表以母公司和子公司的资产负债表为基础，已抵销了母公司与子公司、子公司相互之间发生的内部交易。子公司所有者权益中不属于母公司的份额，作为少数股东权益，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“少数股东权益”项目列示。子公司持有母公司的长期股权投资，视为企业集团的库存股，作为所有者权益的减项，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“减：库存股”项目列示。

4、合并取得子公司会计处理

对于同一控制下企业合并取得的子公司，视同该企业合并于自最终控制方开始实时控制时已经发生，从合并当期的期初起将其资产、负债、经营成果和现金流量纳入合并财务报表；对于非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其个别财务报表进行调整。

(七) 合营安排的分类及共同经营的会计处理方法

1、合营安排的分类

合营安排分为共同经营和合营企业。未通过单独主体达成的合营安排，划分为共同经营。单独主体，是指具有单独可辨认的财务架构的主体，包括单独的法人主体和不具备法人主体资格但法律认可的主体。通过单独主体达成的合营安排，通常划分为合营企业。相关事实和情况变化导致合营方在合营安排中享有的权利和承担的义务发生变化的，合营方对合营安排



的分类进行重新评估。

2、共同经营的会计处理

共同经营参与方应当确认其与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：确认单独所持有的资产或负债，以及按其份额确认共同持有的资产或负债；确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；确认单独所发生的费用，以及按其份额确认共同经营发生的费用。

对共同经营不享有共同控制的参与方，如果享有该共同经营相关资产且承担该共同经营相关负债的，参照共同经营参与方的规定进行会计处理；否则，应当按照相关企业会计准则的规定进行会计处理。

3、合营企业的会计处理

合营企业参与方应当按照《企业会计准则第2号—长期股权投资》的规定对合营企业的投资进行会计处理，不享有共同控制的参与方应当根据其对该合营企业的影响程度进行会计处理。

(八) 现金及现金等价物的确定标准

本公司在编制现金流量表时所确定的现金，是指本公司库存现金以及可以随时用于支付的存款。在编制现金流量表时所确定的现金等价物，是指持有的期限短、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。

(九) 外币业务及外币财务报表折算

1、外币业务折算

本公司对发生的外币交易，采用与交易发生日折合本位币入账。资产负债表日外币货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，除符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本化计入相关资产的成本外，均计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动(含汇率变动)处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

2、外币财务报表折算

本公司的控股子公司、合营企业、联营企业等，若采用与本公司不同的记账本位币，需对其外币财务报表折算后，再进行会计核算及合并财务报表的编报。资产负债表中的资产和



负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，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的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率折算。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其他综合收益下列示。外币现金流量按照系统合理方法确定的，采用交易发生日的即期汇率折算。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，全部或按处置该境外经营的比例转入处置当期损益。

(十) 金融工具

1、金融工具的分类及确认

金融工具划分为金融资产或金融负债。本公司成为金融工具合同的一方时，确认为一项金融资产或金融负债。

金融资产于初始确认时分类为：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、应收款项、可供出售金融资产。除应收款项以外的金融资产的分类取决于本公司及其子公司对金融资产的持有意图和持有能力等。金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及其他金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括持有目的为短期内出售的金融资产；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；可供出售金融资产包括初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产及未被划分为其他类的金融资产；持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且管理层有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

2、金融工具的计量

本公司金融资产或金融负债初始确认按公允价值计量。后续计量分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债按公允价值计量；持有到期投资、贷款和应收款项以及其他金融负债按摊余成本计量；在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产或者衍生金融负债，按照成本计量。本公司金融资产或金融负债后续计量中公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动损益。②可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益。



3、本公司对金融资产和金融负债的公允价值的确认方法

如存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值；如不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

4、金融资产负债转移的确认依据和计量方法

金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，或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，但放弃了对该金融资产控制的，应当终止确认该项金融资产。金融资产满足终止确认条件的，将所转移金融资产的账面价值与因转移而收到的对价和原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额部分，计入当期损益。部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，则应终止确认该金融负债或其一部分。

5、金融资产减值

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

以成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。发生的减值损失，一经确认，不再转回。

当有客观证据表明可供出售金融资产发生减值时，原直接计入股东权益的因公允价值下降形成的累计损失予以转出并计入减值损失。对已确认减值损失的可供出售债务工具投资，在期后公允价值上升且客观上与确认原减值损失后发生的事项有关的，原确认的减值损失予以转回并计入当期损益。对已确认减值损失的可供出售权益工具投资，期后公允价值上升直接计入股东权益。

对于权益工具投资，本公司判断其公允价值发生“严重”或“非暂时性”下跌的具体量化标准、成本的计算方法、期末公允价值的确定方法，以及持续下跌期间的确定依据为：

公允价值发生“严重”下跌的具体量化标准	期末公允价值相对于成本的下跌幅度已达到或超过 50%。
公允价值发生“非暂时性”下跌的具体量化标准	连续 12 个月出现下跌。
成本的计算方法	取得时按支付对价（扣除已宣告但尚未发放的现金股利或已到付息期但尚未领取的债券利息）和相关交易费用之和作为投资成本。
期末公允价值的确定方法	存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值；如不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。



(十一) 衍生金融工具

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行确认，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。

衍生金融工具公允价值变动直接计入当期损益。

(十二) 应收款项

本公司应收款项主要包括应收账款、长期应收款和其他应收款。在资产负债表日有客观证据表明其发生了减值的，本公司根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额确认减值损失。

1、坏账的确认标准

凡因债务人破产，依据法律清偿后确实无法收回的应收款项；债务人死亡，既无遗产可供清偿，又无义务承担人，确实无法收回的应收款项；债务人逾期三年未能履行偿债义务，经股东大会或董事会批准列作坏账的应收款项，以及其他发生减值的债权如果评估为不可收回，则对其终止确认。

2、坏账损失核算方法

本公司采用备抵法核算坏账损失。

3、坏账准备的计提方法及计提比例

在资产负债表日有客观证据表明其发生了减值的，本公司根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额确认减值损失。

(1) 单项金额重大并单项计提坏账准备的应收款项：

单项金额重大并单项计提坏账准备的判断依据或金额标准	应收款项余额中 100 万元（含 100 万元）以上，有客观证据表明可收回性与以信用期和账龄作为风险特征组成类似信用风险特征组合存在明显差异的应收款项，确定为单项金额重大并单项计提坏账的应收款项。
单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

(2) 按组合计提坏账准备的应收款项：

确定组合的依据	
组合	未按单项计提坏账准备的应收款项
按组合计提坏账准备的计提方法	
组合	账龄分析法



采用账龄分析法计提坏账准备情况如下：

账 龄	计提比例
1年以内	5%
1-2年	10%
2-3年	20%
3年以上	50%

(3) 单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的应收账款

单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的判断依据或金额标准	应收款项余额中100万元以下，有客观证据表明可收回性与以信用期和账龄作为风险特征组成类似信用风险特征组合存在明显差异的应收款项，确定为单项金额虽不重大但单项计提坏账的应收款项。
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的计提方法	单独进行减值测试，有客观证据表明其发生了减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

融资融券业务形成的应收融资融券款采用以下方法计提坏账准备：资产负债表日，若客户（含融出资金、约定购回融出资金、股票质押回购融出资金）未按期偿还债务，经强制平仓后，以平仓资金清偿客户所欠债务后仍未能收回的融出资金款项，全额计提坏账准备；对于其他融资类按照资产负债表日融资余额的0.3%计提坏账准备。

(十三) 买入返售与卖出回购款项

1、买入返售金融资产

根据协议承诺将于未来某确定日期返售的金融资产不在资产负债表内予以确认。买入该等资产所支付的成本，在资产负债表中作为买入返售金融资产列示。买入价与返售价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息收入。

2、卖出回购金融资产款

根据协议承诺将于未来某确定日期回购的已售出的金融资产不在资产负债表内予以终止确认。出售该等资产所得的款项，在资产负债表中作为卖出回购金融资产款列示。售价与回购价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息支出。

(十四) 划分为持有待售资产

本公司将同时满足下列条件的非流动资产应当划分为持有待售：一是企业已经就处置该非流动资产作出决议；二是企业已经与受让方签订了不可撤销的转让协议；三是该项转让将在一年内完成。

(十五) 长期股权投资



1、初始投资成本确定

对于企业合并取得的长期股权投资，如为同一控制下的企业合并，应当按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额确认为初始成本；非同一控制下的企业合并，应当按购买日确定的合并成本确认为初始成本；以支付现金取得的长期股权投资，初始投资成本为实际支付的购买价款；以发行权益性证券取得的长期股权投资，初始投资成本为发行权益性证券的公允价值；通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本应当按照《企业会计准则第12号—债务重组》的有关规定确定；非货币性资产交换取得的长期股权投资，初始投资成本根据准则相关规定确定。

2、后续计量及损益确认方法

投资方能够对被投资单位实施控制的长期股权投资应当采用成本法核算，对联营企业和合营企业的长期股权投资采用权益法核算。投资方对联营企业的权益性投资，其中一部分通过风险投资机构、共同基金、信托公司或包括投连险基金在内的类似主体间接持有的，无论以上主体是否对这部分投资具有重大影响，投资方都应当按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》的有关规定，对间接持有的该部分投资选择以公允价值计量且其变动计入损益，并对其余部分采用权益法核算。

3、确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

对被投资单位具有共同控制，是指对某项安排的回报产生重大影响的活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，包括商品或劳务的销售和购买、金融资产的管理、资产的购买和处置、研究与开发活动以及融资活动等；对被投资单位具有重大影响，是指当持有被投资单位20%以上至50%的表决权资本时，具有重大影响。或虽不足20%，但符合下列条件之一时，具有重大影响：在被投资单位的董事会或类似的权力机构中派有代表；参与被投资单位的政策制定过程；向被投资单位派出管理人员；被投资单位依赖投资公司的技术或技术资料；与被投资单位之间发生重要交易。

(十六) 投资性房地产

本公司投资性房地产的类别，包括出租的建筑物。投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量。

本公司投资性房地产中出租的建筑物采用年限平均法计提折旧，具体核算政策与固定资产部分相同。

(十七) 固定资产

1、固定资产确认条件



固定资产指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。同时满足以下条件时予以确认：与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业；该固定资产的成本能够可靠地计量。

2、固定资产分类和折旧方法

本公司固定资产主要分为：房屋建筑物、电子设备、运输设备等；折旧方法采用年限平均法。根据各类固定资产的性质和使用情况，确定固定资产的使用寿命和预计净残值。并在年度终了，对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整。除已提足折旧仍继续使用的固定资产和单独计价入账的土地之外，本公司对所有固定资产计提折旧。

固定资产类别	预计使用年限（年）	年折旧率（%）	预计残值率（%）
房屋及建筑物	40	2.38	5
运输设备	6	16.17	3
电子设备及其他	5	19.40	3

3、融资租入固定资产的认定依据、计价方法

融资租入固定资产为实质上转移了与资产所有权有关的全部风险和报酬的租赁。融资租入固定资产初始计价为租赁期开始日租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值较低者作为入账价值；融资租入固定资产后续计价采用与自有固定资产相一致的折旧政策计提折旧及减值准备。

（十八）在建工程

本公司在建工程按实际成本计量，实际成本包括在建期间发生的各项工程支出以及其他相关费用等。在建工程在工程完工达到预定可使用状态时，结转固定资产。预定可使用状态的判断标准，应符合下列情况之一：固定资产的实体建造（包括安装）工作已经全部完成或实质上已经全部完成；该项建造的固定资产上的支出金额很少或者几乎不再发生；所购建的固定资产已经达到设计或合同要求，或与设计或合同要求基本相符。

（十九）借款费用

1、借款费用资本化的确认原则

本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的购建或者生产的，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。



2、资本化金额计算方法

资本化期间，是指从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间。借款费用暂停资本化的期间不包括在内。在购建或生产过程中发生非正常中断、且中断时间连续超过3个月的，应当暂停借款费用的资本化。

借入专门借款，按照专门借款当期实际发生的利息费用，减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额确定；占用一般借款按照累计资产支出超过专门借款部分的资产支出加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率计算确定，资本化率为一般借款的加权平均利率；借款存在折价或溢价的，按照实际利率法确定每一会计期间应摊销的折价或溢价金额，调整每期利息金额。

实际利率法是根据借款实际利率计算其摊余折价或溢价或利息费用的方法。其中实际利率是借款在预期存续期间的未来现金流量，折现为该借款当前账面价值所使用的利率。

(二十) 无形资产

1、无形资产的计价方法

本公司无形资产按照成本进行初始计量。购入的无形资产，按实际支付的价款和相关支出作为实际成本。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。自行开发的无形资产，其成本为达到预定用途前所发生的支出总额。

本公司无形资产后续计量方法分别为：使用寿命有限无形资产采用直线法摊销，并在年度终了，对无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整；使用寿命不确定的无形资产不摊销，但在年度终了，对使用寿命进行复核，当有确凿证据表明其使用寿命是有限的，则估计其使用寿命，按直线法进行摊销。

2、使用寿命不确定的判断依据

本公司将无法预见该资产为公司带来经济利益的期限，或使用期限不确定等无形资产确定为使用寿命不确定的无形资产。使用寿命不确定的判断依据为：来源于合同性权利或其他法定权利，但合同规定或法律规定无明确使用年限；综合同行业情况或相关专家论证等，仍无法判断无形资产为公司带来经济利益的期限。

每年年末，对使用寿命不确定无形资产使用寿命进行复核，主要采取自下而上的方式，由无形资产使用相关部门进行基础复核，评价使用寿命不确定判断依据是否存在变化等。



3、内部研究开发项目的研究阶段和开发阶段具体标准，以及开发阶段支出符合资本化条件的具体标准

内部研究开发项目研究阶段的支出，于发生时计入当期损益；开发阶段的支出，同时满足下列条件的，确认为无形资产：（1）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；（2）具有完成该无形资产并使用或出售的意图；（3）无形资产产生经济利益的方式，包括能够证明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，无形资产将在内部使用的，能证明其有用性；（4）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；（5）归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量。

划分内部研究开发项目的研究阶段和开发阶段的具体标准：为获取新的技术和知识等进行的有计划的调查阶段，应确定为研究阶段，该阶段具有计划性和探索性等特点；在进行商业性生产或使用前，将研究成果或其他知识应用于某项计划或设计，以生产出新的或具有实质性改进的材料、装置、产品等阶段，应确定为开发阶段，该阶段具有针对性和形成成果的可能性较大等特点。

（二十一）资产减值

长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、无形资产、商誉等长期资产于资产负债表日存在减值迹象的，进行减值测试。减值测试结果表明资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额计提减值准备并计入减值损失。

可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。资产减值准备按单项资产为基础计算并确认，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组确定资产组的可收回金额。资产组是能够独立产生现金流入的最小资产组合。

在财务报表中单独列示的商誉，无论是否存在减值迹象，至少每年进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值分摊至预期从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合。测试结果表明包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额先抵减分摊至该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，以后期间不予转回价值得以恢复的部分。



(二十二) 长期待摊费用

本公司长期待摊费用是指已经支出，但受益期限在一年以上（不含一年）的各项费用。长期待摊费用按费用项目的受益期限分期摊销。若长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益，则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

(二十三) 职工薪酬

职工薪酬，是指企业为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。职工薪酬主要包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

1、短期薪酬

在职工为本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，其他会计准则要求或允许计入资产成本的除外。本公司发生的职工福利费，在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的，按照公允价值计量。企业为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金，以及按规定提取的工会经费和职工教育经费，在职工提供服务的会计期间，根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额，并确认相应负债，计入当期损益或相关资产成本。

2、离职后福利

本公司在职工提供服务的会计期间，根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。根据预期累计福利单位法确定的公式将设定受益计划产生的福利义务归属于职工提供服务的期间，并计入当期损益或相关资产成本。

3、辞退福利

企业向职工提供辞退福利时，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：企业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；企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

4、其他长期职工福利

本公司向职工提供的其他长期职工福利，符合设定提存计划条件的，应当有关设定提存计划的规定进行处理；除此外，根据设定受益计划的有关规定，确认和计量其他长期职工福利净负债或净资产。

(二十四) 预计负债

当与或有事项相关的义务是公司承担的现时义务，且履行该义务很可能导致经济利益流



出，同时其金额能够可靠地计量时确认该义务为预计负债。本公司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，如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；如涉及多个项目，按照各种可能结果及相关概率计算确定最佳估计数。

资产负债表日应当对预计负债账面价值进行复核，有确凿证据表明该账面价值不能真实反映当前最佳估计数，应当按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

(二十五) 股份支付

本公司股份支付包括以权益结算的股份支付和以现金结算的股份支付。以权益结算的股份支付换取职工提供服务的，以授予职工权益工具的公允价值计量。存在活跃市场的，按照活跃市场中的报价确定；不存在活跃市场的，采用估值技术确定，包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

在各个资产负债表日，根据最新取得的可行权人数变动、业绩指标完成情况等后续信息，修正预计可行权的股票期权数量，并以此为依据确认各期应分摊的费用。对于跨越多个会计期间的期权费用，一般可以按照该期权在某会计期间内等待期长度占整个等待期长度的比例进行分摊。

(二十六) 营业收入

1、手续费及佣金收入

代理客户买卖证券的手续费收入，在与客户办理买卖证券款项清算时确认收入。代兑付证券的手续费收入，于代兑付证券业务基本完成，与委托方结算时确认收入。

证券承销收入，以全额包销方式进行承销业务的，在将证券转售给投资者时，按承销价格确认为证券承销收入，按已承销证券的承购价格结转承销证券的成本；以余额包销或代销方式进行承销业务的，于发行结束后，与发行人结算发行价款时确认收入。

受托客户资产管理业务收入，在相关服务提供后，按合同约定方式确认当期收入或损失。

2、利息收入

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。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认为当期收入；



在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期收入。

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息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收益。处置可供出售金融资产时，取得的价款与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额的和与该金融资产账面价值的差额，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，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。

(二十七) 政府补助

1、与资产相关的政府补助会计处理

本公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助，确认为与资产相关的政府补助，与资产相关的政府补助，确认为递延收益，自相关资产可供使用时起，按照相关资产的预计使用期限，将递延收益平均分摊转入当期损益。

2、与收益相关的政府补助会计处理

除与资产相关的政府补助之外的政府补助，确认为与收益相关的政府补助。分别下列情况处理：用于补偿企业以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关费用的期间，计入当期损益；用于补偿企业已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

区分与资产相关政府补助和与收益相关政府补助的具体标准

若政府文件未明确规定补助对象，将该政府补助划分为与资产相关或与收益相关的判断依据：（1）政府文件明确了补助所针对的特定项目的，根据该特定项目的预算中将形成资产的支出金额和计入费用的支出金额的相对比例进行划分，对该划分比例需在每个资产负债表日进行复核，必要时进行变更；（2）政府文件中对用途仅作一般性表述，没有指明特定项目的，作为与收益相关的政府补助。

(二十八) 递延所得税资产和递延所得税负债

1、根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额（未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的，确定该计税基础为其差额），按照预期收回该资产或



清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

2、递延所得税资产的确认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。资产负债表日，有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。如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的，则减记递延所得税资产的账面价值。

3、对与子公司及联营企业投资相关的应纳税暂时性差异，确认递延所得税负债，除非本公司能够控制暂时性差异转回的时间且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对与子公司及联营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，当该暂时性差异在可预见的未来很可能转回且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，确认递延所得税资产。

(二十九) 租赁

1、经营租赁的会计处理方法：经营租赁的租金支出在租赁期内按照直线法计入相关资产成本或当期损益。

2、融资租赁的会计处理方法：以租赁资产的公允价值与最低租赁付款额的现值两者中较低者作为租入资产的入账价值，租入资产的入账价值与最低租赁付款额之间的差额作为未确认融资费用，在租赁期内按实际利率法摊销。最低租赁付款额扣除未确认融资费用后的余额作为长期应付款列示。

(三十) 一般风险准备计提

公司按照净利润（减弥补亏损）的10%计提一般风险准备。

(三十一) 交易风险准备计提

公司按照不低于净利润（减弥补亏损）的10%计提交易风险准备。

(三十二) 客户资产管理业务

公司资产管理业务包括定向资产管理业务和集合资产管理业务。

定向资产管理业务以每个客户的委托资产为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务会计报告。不同的客户资产管理之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面应当相互独立。进行每日资产管理业务投资交易清算复核，保证各个管理账户的净值、股份、资金等数据与会计估值保持一致。

集合资产管理财务报表由公司和托管银行按规定分别独立编制。托管银行在收到公司编制的集合资产管理财务报表后，进行独立的复核。

在编制报表时，资产业务管理形成的资产和负债不在公司资产负债表中反映，但列入财



务报表附注。

（三十三）融资融券业务

融资融券业务，是指本公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。本公司发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

融资业务，本公司对于融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，本公司对于融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应利息收入。

本公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

（三十四）转融通业务

转融通业务是指中国证券金融股份有限公司将自有或者依法筹集的资金或证券出借给本公司，供本公司办理融资融券业务的经营活动。本公司发生的转融通业务包括转融资业务和转融券业务。

1、转融资业务

本公司对于融入的资金，确认对出借方的负债，并确认相应利息费用。

2、转融券业务

本公司对于融入的证券，由于其主要收益或风险不由本公司享有或承担，不确认该证券，并确认相应利息费用。

（三十三）分部报告政策

本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，结合经营分部规模，确定报告分部并披露分部信息。

经营分部，是指本公司内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；

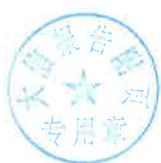
（2）本公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

（3）本公司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。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，本公司将其合并为一个经营分部。

（三十五）主要会计政策变更、会计估计变更的说明

1、报告期会计政策变更说明

本公司在报告期无会计政策变更事项。



2、报告期会计估计变更说明

会计估计变更的内容、原因及适用时点	审批程序	受影响报表科目	影响金额	对净利润影响数
2014年以来,公司融资融券业务及股票质押业务发展迅速,为了准确反映公司融资融券业务及股票质押业务的风险状况,依据谨慎性原则,并参考同业已有案例,对公司融出资金及股票质押式回购款进行会计估计变更。2015年变更前融资融券业务形成的应收融资融券款采用以下方法计提坏账准备:资产负债表日,公司6个月以内的融出资金余额不计提坏账,6个月以上的融出资金按其余额计提1%的融资融券减值准备。但若客户未按期偿还债务,经强制平仓后,以平仓资金清偿客户所欠债务后仍未能收回的融出资金款项,全额计提坏账准备。自2015年开始,资产负债表日,若客户(含融出资金、约定购回融出资金、股票质押回购融出资金)未按期偿还债务,经强制平仓后,以平仓资金清偿客户所欠债务后仍未能收回的融出资金款项,全额计提坏账准备;对于其他融资类按照资产负债表日融资余额的0.3%计提坏账准备。	本公司 2015年临时董事会会议已批准通过此会计估计变更的决议	融出资金	-4,875,824.52	-10,940,464.27
		买入返售金融资产	-9,711,461.17	
		资产减值损失	14,587,285.69	

四、税项

(一) 主要流转税税种及税率

税种	计税依据	适用税率
营业税	应税收入	5%
城市维护建设税	应纳营业税	7%、5%
教育费附加	应纳营业税	3%

(二) 所得税

公司下属各营业部由公司总部统一办理所得税涉税事项,公司所得税率均为25%;公司全资子公司天风天盈投资有限公司2014年按核定征收,核定应税所得率为10%,2015年改为查账征收,所得税税率为25%;公司全资子公司天风天盈投资有限公司的控股子公司天风天信财富投资管理有限公司2015年按核定征收,核定应税所得率为10%。



五、合并财务报表重要项目注释

(一) 货币资金

1、按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
库存现金	1,099,545.66	566,538.18
银行存款	5,387,630,421.41	2,013,766,386.91
其中：客户存款	2,763,315,929.97	1,506,047,888.85
公司存款	2,624,314,491.44	507,718,498.06
其他货币资金	7,850,078.74	
合 计	5,396,580,045.81	2,014,332,925.09

2、按币种列示

项 目	期末余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
客户资金存款：			
人民币			2,570,023,311.73
美元	673,630.20	6.4936	4,374,285.07
港币	2,177,659.23	0.8378	1,824,399.34
小计			2,576,221,996.14
客户信用资金存款			
人民币			187,093,933.83
小计			187,093,933.83
客户存款合计			2,763,315,929.97
公司自有资金存款：			
人民币			2,617,351,923.58
美元	1,072,220.01	6.4936	6,962,567.86
小计			2,624,314,491.44
公司存款合计			2,624,314,491.44
合 计			5,387,630,421.41

项 目	期初余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
客户资金存款：			
人民币			1,344,170,710.20
美元	79,650.68	6.1190	487,382.51
港币	1,978,223.24	0.7889	1,560,561.01
小计			1,346,218,653.72



项 目	期初余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
客户信用资金存款			
人民币			159,829,235.13
小计			159,829,235.13
客户存款合计			1,506,047,888.85
公司自有资金存款:			
人民币			501,160,908.76
美元	1,071,676.63	6.1190	6,557,589.30
小计			507,718,498.06
公司存款合计			507,718,498.06
合 计			2,013,766,386.91

(二) 结算备付金

1、按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
客户备付金	1,274,756,757.63	845,540,898.21
公司备付金	531,495,747.74	71,199,027.17
合 计	1,806,252,505.37	916,739,925.38

2、按币种列示

项 目	期末余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
客户普通备付金:			
人民币			766,730,688.75
美元	310,075.32	6.4936	2,013,505.11
港币	3,166,340.88	0.8378	2,652,697.07
小计			771,396,890.93
客户信用备付金:			
人民币			503,359,866.70
小计			503,359,866.70
客户备付金合计			1,274,756,757.63
公司自有备付金:			
人民币			530,835,762.20
美元	0.02	6.4936	0.13
港币	31.10	0.8378	26.05
小计			530,835,788.38
公司信用备付金:			



项 目	期末余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
人民币			659,959.36
小计			659,959.36
公司备付金合计			531,495,747.74
合 计			1,806,252,505.37

项 目	期初余额		
	原币金额	折算汇率	折合人民币金额
客户普通备付金：			
人民币			732,534,547.74
美元	228,143.44	6.1190	1,396,009.71
港币	3,329,719.15	0.7889	2,626,715.55
小计			736,557,273.00
客户信用备付金：			
人民币			108,983,625.21
小计			108,983,625.21
客户备付金合计			845,540,898.21
公司自有备付金：			
人民币			71,190,754.22
美元			
港币			
小计			71,190,754.22
公司信用备付金：			
人民币			8,272.95
小计			8,272.95
公司备付金合计			71,199,027.17
合 计			916,739,925.38

(三)融出资金

1、按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
融资融券业务融出资金	1,625,274,836.82	1,348,943,456.22
减：减值准备	4,875,824.52	114,165.82
融出资金净值	1,620,399,012.30	1,348,829,290.40



2、按账龄分析

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1-3个月	1,195,198,483.99	73.54	3,585,595.45	0.30
3-6个月	157,511,214.68	9.69	472,533.64	0.30
6个月以上	272,565,138.15	16.77	817,695.43	0.30
合计	1,625,274,836.82	100.00	4,875,824.52	

账龄	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1-3个月	234,124,608.00	17.35		
3-6个月	1,114,704,682.40	82.64		
6个月以上	114,165.82	0.01	114,165.82	100.00
合计	1,348,943,456.22	100.00	114,165.82	

3、客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值：

项目	期末公允价值	期初公允价值
资金	311,730,655.22	199,099,588.17
股票	4,593,202,889.94	2,921,757,259.32
合计	4,904,933,545.16	3,120,856,847.49

(四)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

1、按类别列示

类别	期末余额	期初余额
交易性金融资产	8,740,190,905.94	2,917,366,787.95
其中：债务工具投资	6,203,537,842.80	2,161,352,394.70
权益工具投资	2,122,209,487.82	624,633,210.75
基金投资	414,443,575.32	131,381,182.50
合计	8,740,190,905.94	2,917,366,787.95

2、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中已融出证券情况

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中已融出证券期末余额的公允价值为0.00元；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中已融出证券期初余额的公允价值为2,548,582.00元。



(五) 衍生金融资产/负债

类别	期末余额					
	套期工具			非套期工具		
	名义金额(元)	公允价值		名义金额	公允价值	
资产		负债	资产		负债	
1、利率衍生工具						
2、利率互换业务				6,770,000,000.00	394,324.13	
3、权益衍生工具						
4、沪深300股指期货业务(注)	17,755,160.00			46,399,120.00		
5、国债期货				221,732,100.00		
6、期权	10,630,400.00	1,601,630.00				
7、商品期货				8,652,215.00		

类别	期初余额					
	套期工具			非套期工具		
	名义金额(元)	公允价值		名义金额(元)	公允价值	
资产		负债	资产		负债	
1、利率衍生工具						
2、利率互换业务				2,680,000,000.00	4,049,710.31	
3、权益衍生工具						
4、沪深300股指期货业务(注)	8,591,520.00			50,475,180.00		
5、国债期货				12,571,780.00		

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额列示为0元。

(六) 买入返售金融资产

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
股票	3,237,153,724.32	223,243,811.87
债券	5,394,407,742.09	5,159,057,273.11
其中：国债	28,317,083.17	10,000,000.00
企业债	4,754,141,286.21	4,368,846,019.29
短期融资券	611,949,372.71	780,211,253.82
减：减值准备	9,711,461.17	
买入返售金融资产账面价值	8,621,850,005.24	5,382,301,084.98



2、按业务类别列示

业务物类别	期末余额	期初余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	3,237,153,724.32	223,243,811.87
银行间买断式买入返售	5,366,090,658.92	5,149,057,273.11
银行间质押式买入返售		
交易所质押式买入返售	28,317,083.17	10,000,000.00
减：减值准备	9,711,461.17	
买入返售金融资产账面价值	8,621,850,005.24	5,382,301,084.98

3、股票质押式回购的剩余期限

期限	期末余额	期初余额
1个月以内		582,500.00
1个月至1年	2,200,192,456.80	216,900,800.00
1年以上	1,036,961,267.52	5,760,511.87
合计	3,237,153,724.32	223,243,811.87

5、买入返售金融资产收取的担保物公允价值

担保物类别	期末余额	期初余额
股票	11,077,340,179.79	400,128,709.30
债券	5,394,382,790.84	5,159,057,273.11
合计	16,471,722,970.63	5,559,185,982.41

(七) 应收利息

项 目	期末余额	期初余额
债券投资利息	3,015,280.13	913,856.29
存放金融同业	1,093,747.85	718,791.67
买入返售金融资产	80,151,080.04	21,897,431.31
融资融券利息	25,939,600.57	
其他	21,418,612.64	7,871,453.82
减：减值准备	778,492.60	
合 计	130,839,828.63	31,401,533.09

(八) 存出保证金

项 目	期末余额	期初余额
证券交易保证金	134,662,068.89	26,285,289.66



项 目	期末余额	期初余额
信用保证金	13,953,485.58	2,303,594.32
期货交易保证金	374,170,256.20	319,737,616.50
期货结算准备金	344,632,586.06	130,715,082.00
转融通业务担保金	113,967,744.02	41,800,000.00
合 计	981,386,140.75	520,841,582.48

(九)划分为持有待售的资产

项 目	期末余额	期初余额
成都房产		51,243,735.00
高科大厦房产	21,965,476.16	21,965,476.16
股权投资	3,000,000.00	
合 计	24,965,476.16	73,209,211.16

(十)可供出售金融资产

1、可供出售金融资产分类

项 目	期末数			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
按公允价值计量：				
债券	15,868,395.75	1,975,949.25		17,844,345.00
基金	36,000,000.00	148,190.20		36,148,190.20
股票	227,511,412.29	207,018,475.46		434,529,887.75
集合理财产品	1,600,937,462.79	173,074,799.82		1,774,012,262.61
信托计划	81,000,000.00			81,000,000.00
资产管理	150,000,000.00	11,046,000.00		161,046,000.00
新三板股权	261,148,000.00			261,148,000.00
私募基金	291,400,000.00	-79,225.00		291,320,775.00
收益互换产品	1,745,400,000.00	16,960,428.67		1,762,360,428.67
按成本计量：				
权益工具	2,752,945,165.34		1,330,415.34	2,751,614,750.00
合 计	7,162,210,436.17	410,144,618.40	1,330,415.34	7,571,024,639.23

项 目	期初数			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
按公允价值计量：				
债券	15,868,395.75	1,045,154.25		16,913,550.00
股票	29,925,000.00	6,405,000.00		36,330,000.00



项 目	期初数			
	初始成本	公允价值变动	减值准备	账面价值
集合理财产品	419,628,694.23	43,140,840.24		462,769,534.47
信托计划	234,340,000.00			234,340,000.00
资产管理	42,080,000.00			42,080,000.00
新三板股权	67,250,000.00			67,250,000.00
其他	30,000,000.00			30,000,000.00
按成本计量：				
权益工具	172,785,415.34		1,330,415.34	171,455,000.00
合 计	1,011,877,505.32	50,590,994.49	1,330,415.34	1,061,138,084.47

2、期末按公允价值计量的可供出售金融资产

分类	期末数			
	权益工具的成本 /债务工具的摊 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	减值准备
债券	15,868,395.75	17,844,345.00	1,975,949.25	
基金	36,000,000.00	36,148,190.20	148,190.20	
股票	227,511,412.29	434,529,887.75	207,018,475.46	
证券公司理财产品	1,600,937,462.79	1,774,012,262.61	173,074,799.82	
信托计划	81,000,000.00	81,000,000.00	0.00	
资产管理	150,000,000.00	161,046,000.00	11,046,000.00	
新三板股权	261,148,000.00	261,148,000.00	0.00	
私募基金	291,400,000.00	291,320,775.00	-79,225.00	
收益互换产品	1,745,400,000.00	1,762,360,428.67	16,960,428.67	
合 计	4,409,265,270.83	4,819,409,889.23	410,144,618.40	

分类	期初数			
	权益工具的成本 /债务工具的摊 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	减值准备
债券	15,868,395.75	16,913,550.00	1,045,154.25	
股票	29,925,000.00	36,330,000.00	6,405,000.00	
证券公司理财产品	419,628,694.23	462,769,534.47	43,140,840.24	
信托计划	234,340,000.00	234,340,000.00		
资产管理	42,080,000.00	42,080,000.00		
新三板股权	67,250,000.00	67,250,000.00		
其他	30,000,000.00	30,000,000.00		
合 计	839,092,089.98	889,683,084.47	50,590,994.49	



(十一) 长期股权投资

被投资单位	期初余额	本期增减变动								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											
武汉奥多生物医药有限公司	1,132,539.30			-486,953.80							645,585.50
小计	1,132,539.30			-486,953.80							645,585.50
二、联营企业											
北京金盛博资产管理有限公	16,673,906.19			-1,121,569.55						-15,552,336.64	
湖北银丰天睿资产管理有限	40,000,000.00			4,358,902.46	21,029.44						44,379,931.90
湖北三环资本管理有限公司		22,500,000.00		-418,351.01							22,081,648.99
正隆(北京)保险经纪股份有限		20,000,000.00		-3,543,539.56							16,456,461.44
武汉普创科技有限公司		3,000,000.00		-491,116.70							2,508,883.30
武汉长江众筹金融交易有限		5,000,000.00		-864,582.90							4,135,417.10
武汉国创资本投资有限公司		514,153,900.00		7,284,831.60					-7,189,537.93		514,249,193.67
宜宾市商业银行股份有限公司		541,551,919.00		13,753,326.17	2,930,893.24					17,488,350.00	540,747,788.41
小计	56,673,906.19	1,106,205,819.00		18,957,901.51	2,951,922.68	-7,189,537.93	17,488,350.00		-15,552,336.64		1,144,559,324.81
合计	57,806,445.49	1,106,205,819.00		18,470,947.71	2,951,922.68	-7,189,537.93	17,488,350.00		-15,552,336.64		1,145,204,910.31



(十二) 投资性房地产

1、按成本计量的投资性房地产

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
一、原价合计	105,933,878.24	11,223,865.18		117,157,743.42
房屋建筑物	105,933,878.24	11,223,865.18		117,157,743.42
二、累计折旧和累计摊销合计	7,623,183.90	4,639,018.70		12,262,202.60
房屋建筑物	7,623,183.90	4,639,018.70		12,262,202.60
三、投资性房地产减值准备累计金额合计				
房屋建筑物				
四、投资性房地产账面价值合计	98,310,694.34			104,895,540.82
房屋建筑物	98,310,694.34			104,895,540.82

2、期末投资性房地产不存在减值情况。

(十三) 固定资产

1、账面价值

项 目	期末余额	期初余额
固定资产原价	251,964,890.79	186,762,052.12
减：累计折旧	98,192,642.52	89,075,292.67
固定资产减值准备	558,864.89	558,864.89
固定资产账面价值合计	153,213,383.38	97,127,894.56

2、固定资产增减变动表

项 目	房屋及建筑物	运输工具	电子设备	合 计
一、账面原值				
1.期初余额	77,409,611.52	16,813,689.09	92,538,751.51	186,762,052.12
2.本期增加金额	53,509,700.00	3,602,241.76	27,398,492.08	84,510,433.84
(1) 购置	53,509,700.00	3,602,241.76	26,817,263.08	83,929,204.84
(2) 企业合并增加			581,229.00	581,229.00
3.本期减少金额	10,958,793.97	1,287,208.00	7,061,593.20	19,307,595.17
(1) 处置或报废	3,334,928.79	1,287,208.00	7,061,593.20	11,683,729.99
(2) 转入投资性房地产	7,623,865.18			7,623,865.18
4.期末余额	119,960,517.55	19,128,722.85	112,875,650.39	251,964,890.79
二、累计折旧				
1.期初余额	10,323,862.80	13,134,445.97	65,616,983.90	89,075,292.67
2.本期增加金额	3,648,856.36	1,700,428.13	12,195,272.95	17,544,557.44
(1) 计提	3,648,856.36	1,700,428.13	12,059,616.31	17,408,900.80
(2) 企业合并增加			135,656.64	135,656.64



项 目	房屋及建筑物	运输工具	电子设备	合 计
3.本期减少金额	1,870,229.01	1,004,431.26	5,552,547.32	8,427,207.59
(1) 处置或报废	1,007,461.59	1,004,431.26	5,552,547.32	7,564,440.17
(2) 转入投资性房地产	862,767.42			862,767.42
4.期末余额	12,102,490.15	13,830,442.84	72,259,709.53	98,192,642.52
三、减值准备				
1.期初余额			558,864.89	558,864.89
2.本期增加金额				
(1) 计提				
3.本期减少金额				
(1) 处置或报废				
4.期末余额			558,864.89	558,864.89
四、账面价值				
1.期末账面价值	107,858,027.40	5,298,280.01	40,057,075.97	153,213,383.38
2.期初账面价值	67,085,748.72	3,679,243.12	26,362,902.72	97,127,894.56

3、截止期末余额，通过融资租赁租入的固定资产情况

类 别	账面原值	累计折旧	减值准备	账面价值
电子设备	1,685,731.80	112,382.12		1,573,349.68
合 计	1,685,731.80	112,382.12		1,573,349.68

(十四) 无形资产

项 目	交易席位费	软件使用权	土地使用权	特许经营权	合 计
一、账面原值					
1.期初余额	1,950,000.00	66,048,385.83	8,314,788.00	20,800,000.03	97,113,173.86
2.本期增加金额		35,189,420.88			35,189,420.88
(1) 购置		35,189,420.88			35,189,420.88
3.本期减少金额		930,000.00			930,000.00
(1) 处置		930,000.00			930,000.00
4.期末余额	1,950,000.00	100,307,806.71	8,314,788.00	20,800,000.03	131,372,594.74
二、累计摊销					
1.期初余额		36,455,860.53	388,023.44		36,843,883.97
2.本期增加金额		15,144,286.74	166,295.76		15,310,582.50
(1) 计提		15,144,286.74	166,295.76		15,310,582.50
3.本期减少金额		930,000.00			930,000.00
(1) 处置		930,000.00			930,000.00
4.期末余额		50,670,147.27	554,319.20		51,224,466.47
三、减值准备					
1.期初余额					



项 目	交易席位费	软件使用权	土地使用权	特许经营权	合 计
2.本期增加金额					
(1) 计提					
3.本期减少金额					
(1) 处置					
4.期末余额					
四、账面价值					
1.期末账面价值	1,950,000.00	49,637,659.44	7,760,468.80	20,800,000.03	80,148,128.27
2.期初账面价值	1,950,000.00	29,592,525.30	7,926,764.56	20,800,000.03	60,269,289.89

(十五) 商誉

项目	期初余额	本期增加	本期摊销	本期减少	期末余额
非同一控制下控股合并天风期货股份有限公司形成商誉（注1）	15,209,584.51				15,209,584.51
非同一控制下控股合并长瑞当代资本管理有限公司形成商誉（注2）	297,422.53				297,422.53
非同一控制下控股合并光谷创投基金管理有限公司形成商誉（注3）	45,237.49				45,237.49
非同一控制下控股合并北京金盛博资产管理有限公司形成商誉（注4）		2,039,719.46			2,039,719.46
合 计	15,552,244.53	2,039,719.46			17,591,963.99

注：（1）2008年非同一控制下控股合并天风期货股份有限公司时，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；

（2）2013年非同一控制下控股合并长瑞当代资本管理有限公司时，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；

（3）2013年非同一控制下控股合并光谷创投基金管理有限公司时，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；

（4）商誉计算过程：

被投资单位名称	出让方	转 让 股 权 比 例 (%)	股权转让日	转让价	转让时点享有被投资单位净资产公允价值	商誉
天风期货股份有限公司	南通东海明珠投资有限公司	51.00	2008年8月7日	43,350,000.00	28,140,415.49	15,209,584.51
光谷创投基金管理有限公司	武汉恒健通科技有限责任公司；武汉夏天科技发展有限公司	55.00	2013年8月6日	8,250,000.00	8,204,762.51	45,237.49
长瑞当代资本管理有限公司	武汉当代地产开发有限公司、潘文涛、宋鹏、徐亚文等	51.00	2013年8月1日	10,356,712.33	10,059,289.80	297,422.53
北京金盛博资产管理有限公司	中铁信托有限责任公司	30.00	2015年7月15日	15,000,000.00	12,960,280.54	2,039,719.46
合 计				76,956,712.33	59,364,748.34	17,591,963.99



(十六) 递延所得税资产和递延所得税负债

1、已确认的递延所得税资产和递延所得税负债

项 目	期末余额	期初余额
递延所得税资产：		
资产减值	3,128,291.30	3,315,114.81
交易性金融资产		
可供出售金融资产	49,500.00	
衍生金融工具		328,221.50
融出资金	1,218,956.13	
买入返售金融资产	2,427,865.29	
其他资产	5,405,873.15	
合 计	12,230,485.87	3,643,336.31
递延所得税负债：		
交易性金融资产	71,399,912.08	18,140,438.83
可供出售金融资产	50,801,342.01	10,943,379.20
衍生金融工具	498,988.53	
合 计	122,700,242.62	29,083,818.03

2、引起暂时性差异的资产或负债项目对应的暂时性差异

项 目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异：		
资产减值	12,513,165.16	13,260,459.25
交易性金融资产		
可供出售金融资产	198,000.00	
衍生金融工具		1,312,886.02
融出资金	4,875,824.52	
买入返售金融资产	9,711,461.17	
其他资产	21,623,492.60	
合 计	48,921,943.45	14,573,345.27
应纳税暂时性差异：		
交易性金融资产	285,599,648.30	72,561,755.32
可供出售金融资产	210,835,654.27	43,773,516.81
衍生金融工具	1,995,954.13	
合 计	498,431,256.70	116,335,272.13



(十七) 资产减值准备

项 目	期初余额	本期增加额		本期减少额		期末余额
		计提	其他增加	转回	转销	
坏账准备	10,790,180.41	4,085,114.67		1,066,825.11	88,399.00	13,720,070.97
可供出售金融资产减值准备	1,330,415.34					1,330,415.34
固定资产减值准备	4,092,742.39				3,533,877.50	558,864.89
融出资金减值准备	114,165.82	4,875,824.52				4,989,990.34
买入返售金融资产减值准备		9,711,461.17				9,711,461.17
其他流动资产减值准备		20,845,000.00				20,845,000.00
应收利息减值准备		778,492.60				778,492.60
合 计	16,327,503.96	40,295,892.96		1,066,825.11	3,622,276.50	51,934,295.31

(十八) 其他资产

1、 按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
应收股利	583,216.80	225,000.00
预付账款	245,480,130.84	91,208,883.66
其他应收款	102,106,162.54	81,980,194.30
长期待摊费用	45,310,576.22	44,288,415.84
其他流动资产	890,570,959.00	672,897,677.41
其他非流动资产	759,447,582.24	563,000,000.00
减：减值准备	33,315,588.12	10,537,724.66
合 计	2,010,183,039.52	1,443,062,446.55

2、 其他应收款

类 别	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款	3,774,679.75	3.70	3,774,679.75	100
按组合计提坏账准备的其他应收款	98,217,316.97	96.19	8,581,742.55	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款	114,165.82	0.11	114,165.82	100
合 计	102,106,162.54	100.00	12,470,588.12	



类别	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项金额重大并单项计提坏账准备的其他应收款	3,774,679.75	4.60	3,774,679.75	100
按组合计提坏账准备的其他应收款	78,205,514.55	95.40	6,763,044.91	5-50
单项金额虽不重大但单项计提坏账准备的其他应收款				
合计	81,980,194.30	100.00	10,537,724.66	

(1) 截止期末余额，期末单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款

债务人名称	账面余额	坏账金额	账龄	计提比例	计提理由
成都联贸实业有限公司	3,774,679.75	3,774,679.75	5年以上	100.00	账龄较长，难以收回
合计	3,774,679.75	3,774,679.75			

(2) 按组合计提坏账准备的其他应收款

①采用账龄分析法计提坏账准备的其他应收款

账龄	期末数			期初数		
	金额	比例 (%)	坏账准备	金额	比例 (%)	坏账准备
1年以内	52,981,722.67	53.94	2,649,086.13	63,912,667.99	81.72	3,195,633.41
1-2年	38,478,769.88	39.18	3,847,876.99	6,859,693.47	8.77	685,969.34
2-3年	4,312,109.25	4.39	862,421.85	2,783,781.33	3.56	556,756.26
3年以上	2,444,715.17	2.49	1,222,357.58	4,649,371.76	5.95	2,324,685.90
合计	98,217,316.97	100.00	8,581,742.55	78,205,514.55	100.00	6,763,044.91

3、长期待摊费用

项目	期初余额	本年增加	本年摊销	其他减少	期末余额
装修改造费	41,006,717.85	17,842,324.28	16,237,694.70		42,611,347.43
软件服务费	3,199,407.85	230,997.00	1,247,367.37		2,183,037.48
其他	82,290.14	535,009.00	101,107.83		516,191.31
合计	44,288,415.84	18,608,330.28	17,586,169.90		45,310,576.22

(十九) 应付短期融资款

债券类型	票面利率	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
收益凭证(注)	4.80%-6.70%	31,081,164.33	3,026,726,575.00	1,767,827,739.33	1,289,980,000.00
短期公司债券	5.10%		650,000,000.00		650,000,000.00
合计		31,081,164.33	3,676,726,575.00	1,767,827,739.33	1,939,980,000.00

注：本公司期末余额尚未到期的期限小于一年的收益凭证共计12笔，未到期产品的收益率为4.80%至6.70%。



(二十) 拆入资金

项 目	期末余额	期初余额
转融通融入资金	167,000,000.00	513,206,986.75
合 计	167,000,000.00	513,206,986.75

(二十一) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

项 目	期末数			期初数		
	公允 价值	投资 成本	公允价值 变动损益	公允 价值	投资 成本	公允价值 变动损益
交易性金融负债				308,892,200.00	307,579,313.98	1,312,886.02
其中： 债券				308,892,200.00	307,579,313.98	1,312,886.02
合 计				308,892,200.00	307,579,313.98	1,312,886.02

(二十二) 卖出回购金融资产款

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
债券	8,440,465,464.75	6,521,508,481.16
其中： 国债	131,210,000.00	103,027,934.20
企业债	7,510,197,237.97	5,495,908,902.57
金融债	190,000,000.00	156,177,984.11
短期融资券	609,058,226.78	766,393,660.28
融资融券债权收益权	2,266,000,000.00	300,000,000.00
合 计	10,706,465,464.75	6,821,508,481.16

2、按业务类别列示

业务物类别	期末余额	期初余额
交易所质押式回购	131,210,000.00	103,027,934.20
银行间质押式卖出回购	3,091,490,000.00	1,572,400,000.00
银行间买断式卖出回购	5,217,765,464.75	4,846,080,546.96
融资融券债权收益权转让回购	2,266,000,000.00	300,000,000.00
合 计	10,706,465,464.75	6,821,508,481.16



3、卖出回购金融资产款的担保物公允价值

担保物类别	期末余额	期初余额
股票	1,050,000,000.00	
债券	8,769,303,427.51	6,667,762,130.20
融资融券债权收益权	1,374,119,468.48	333,827,964.65
合计	11,193,422,895.99	7,001,590,094.85

(二十三) 代理买卖证券款

项目	期末余额	期初余额
普通经纪业务	3,860,769,613.70	2,421,716,345.72
个人	3,342,664,978.26	1,839,891,642.92
机构	518,104,635.44	581,824,702.80
信用经纪业务	311,769,694.58	199,099,582.55
个人	309,398,992.33	193,955,955.89
机构	2,370,702.25	5,143,626.66
合计	4,172,539,308.28	2,620,815,928.27

(二十四) 应付职工薪酬

1、应付职工薪酬分类列示

项目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
一、短期薪酬	64,734,380.08	1,070,684,715.54	571,825,910.36	563,593,185.26
二、离职后福利-设定提存计划	13,697.19	26,901,049.72	26,553,641.84	361,105.07
合计	64,748,077.27	1,097,585,765.26	598,379,552.20	563,954,290.33

2、短期薪酬

短期薪酬项目	期初余额	本年增加额	本年减少额	期末余额
1.工资、奖金、津贴和补贴	63,465,752.98	1,029,788,643.07	530,551,750.07	562,702,645.98
2.职工福利费		9,212,445.65	9,212,445.65	
3.社会保险费	73,479.75	13,531,494.36	13,381,905.38	223,068.73
其中：医疗保险费	73,301.05	12,173,220.53	12,046,737.11	199,784.47
工伤保险费	178.70	525,161.69	517,316.80	8,023.59
生育保险费		833,112.14	817,851.47	15,260.67
4.住房公积金	76,122.81	13,252,811.85	13,243,224.76	85,709.90
5.工会经费和职工教育经费	1,119,024.54	4,899,320.61	5,436,584.50	581,760.65
6.其他短期薪酬				
合计	64,734,380.08	1,070,684,715.54	571,825,910.36	563,593,185.26



3、 离职后福利

设定提存计划项目	期初余额	本年增加额	本年减少额	期末余额
1.基本养老保险费		25,355,669.95	25,029,370.85	326,299.10
2.失业保险费	13,697.19	1,545,379.77	1,524,270.99	34,805.97
合 计	13,697.19	26,901,049.72	26,553,641.84	361,105.07

(二十五) 应交税费

税 种	期末余额	期初余额
营业税	44,941,870.36	25,880,952.15
城建税	3,186,013.43	1,870,912.01
企业所得税	241,248,791.14	36,591,854.99
地方教育费附加	913,507.21	500,218.99
个人所得税	3,386,103.50	2,687,196.71
教育费附加	1,321,512.47	746,838.36
其他	2,206,375.48	2,078,529.63
合 计	297,204,173.59	70,356,502.84

(二十六) 应付款项

项 目	期末余额	期初余额
应付清算款项	1,152,547.49	16,321,045.32
期货风险准备金	15,329,527.12	12,946,468.63
应付手续费及佣金	22,894,879.31	30,402,821.67
合 计	39,376,953.92	59,670,335.62

(二十七) 应付利息

项 目	期末余额	期初余额
应付债券、长期收益凭证	84,700,897.98	43,294,794.52
应付短期融资款、短期公司债	51,439,026.03	
卖出回购	68,636,364.69	16,390,580.06
客户资金	7,782.66	6,478.66
拆入资金	4,385,500.00	
其他	10,914,891.50	3,213,625.06
合 计	220,084,462.86	62,905,478.30



(二十八) 应付债券

债券类型	发行日期	到期日期	票面利率	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
次级债券	2014.3.26	2017.3.26	7.65%	500,000,000.00			500,000,000.00
公司债	2014.9.2	2017.9.2	6.82%	596,425,600.00	1,306,932.48		597,732,532.48
次级债券	2014.12.25	2017.12.25	6.25%	250,000,000.00			250,000,000.00
15年长期公司债	2015.7.31	2018.7.31	4.23%		1,191,564,616.65		1,191,564,616.65
15天风次级债	2015.10.28	2020.10.28	5.50%		1,983,574,097.77		1,983,574,097.77
天利15076	2015.7.30	2017.1.20	6.10%		100,000,000.00		100,000,000.00
天融2号006	2015.7.31	2017.1.30	6.10%		100,000,000.00		100,000,000.00
天惠3号	2015.7.14	2017.1.11	6.60%		206,184,109.59		206,184,109.59
天利15075	2015.7.16	2016.12.30	6.20%		102,870,684.93		102,870,684.93
天利15081	2015.8.10	2017.1.20	6.00%		102,367,123.29		102,367,123.29
天融2号005	2015.9.1	2017.2.28	5.80%		200,000,000.00		200,000,000.00
天财3号	2015.11.24	2017.5.24	5.10%		201,061,917.81		201,061,917.81
天财4号	2015.12.23	2017.12.21	5.20%		200,256,438.36		200,256,438.36
合计				1,346,425,600.00	4,389,185,920.88		5,735,611,520.88

注：(1) 2015年7月，公司根据中国证券监督管理委员会2015年7月出具的《关于核准天风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[2015]1694号)发行公司债券，合计发行债券人民币120,000.00万元。

(2) 2015年10月，公司发行次级债券面值为人民币200,000.00万元。

(3) 2015年7月至12月，公司发行8期期限大于一年的收益凭证120,000.00万元。

(二十九) 其他负债

项目	期末余额	期初余额
应付账款	52,750,298.43	8,548,635.24
预收账款	27,727,240.49	56,216,524.54
其他应付款	26,281,257.15	104,316,368.99
其他流动负债	451,100,000.00	35,769,996.47
其他非流动负债	1,010,449,000.00	171,000,000.00
应付股利	3,254,000.00	474,000.00
长期应付款	1,548,544.51	
合计	1,573,110,340.58	376,325,525.24

(三十) 股本

投资者名称	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
武汉国有资产经营公司	423,016,391.00	213,636,364.00		636,652,755.00
人福医药集团股份公司	386,780,623.00	136,363,636.00		523,144,259.00
湖北省联合发展投资集团有限公司	305,723,360.00	213,636,364.00		519,359,724.00
陕西大德投资集团有限责任公司	229,410,093.00			229,410,093.00



投资者名称	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
武汉高科国有控股集团有限公司	150,168,322.00			150,168,322.00
湖北省科技投资集团有限公司	133,712,820.00			133,712,820.00
武汉恒健通科技有限责任公司	80,732,645.00	60,000,000.00		140,732,645.00
武汉市仁军投资咨询有限责任公司	76,662,462.00			76,662,462.00
武汉银海置业有限公司	96,177,066.00	30,000,000.00		126,177,066.00
上海潞安投资有限公司	66,856,410.00	17,134,395.00		83,990,805.00
四川华西集团有限公司	55,032,377.00	14,104,055.00		69,136,432.00
武汉市铁源物资有限公司	52,434,150.00	15,000,000.00		67,434,150.00
湖北京山轻工机械股份有限公司	10,576,110.00			10,576,110.00
武汉奥兴高科技开发有限公司	49,077,434.00			49,077,434.00
上海鼎石投资管理有限公司	10,000,000.00			10,000,000.00
武汉道博股份有限公司	49,082,732.00			49,082,732.00
武汉三特索道集团股份有限公司	21,309,435.00	4,500,000.00		25,809,435.00
武汉新洪农工商有限责任公司	19,364,594.00	30,500,000.00		49,864,594.00
上海和生投资有限公司	11,090,000.00			11,090,000.00
四川创美实业有限公司	11,090,000.00			11,090,000.00
武汉当代科技产业集团股份有限公司	102,832,976.00	45,495,186.00		148,328,162.00
中航信托股份有限公司		200,000,000.00		200,000,000.00
苏州建丰九鼎投资中心（有限合伙）		184,000,000.00		184,000,000.00
北京融鼎富投资管理有限公司		100,000,000.00		100,000,000.00
宁波光大金控财智汇通股权投资中心（有限合伙）		72,500,000.00		72,500,000.00
苏州湾流重明投资中心（有限合伙）		60,000,000.00		60,000,000.00
富沃投资（江苏）有限公司		60,000,000.00		60,000,000.00
深圳麦肯特中南投资有限公司		50,000,000.00		50,000,000.00
成都奎星物流有限公司		50,000,000.00		50,000,000.00
嘉兴元泽投资中心（有限合伙）		46,000,000.00		46,000,000.00
湖北省鄂西生态文化旅游圈投资有限公司		45,000,000.00		45,000,000.00
宁波厚泽顺势股权投资合伙企业（有限合伙）		40,000,000.00		40,000,000.00
上海广承投资管理中心（有限合伙）		30,000,000.00		30,000,000.00
武汉恒泰睿风投资合伙企业（有限合伙）		25,000,000.00		25,000,000.00
武汉光谷投资担保有限公司		22,000,000.00		22,000,000.00
广东九天影视广告有限公司		20,000,000.00		20,000,000.00
武汉瀛孚投资管理中心（普通合伙）		11,000,000.00		11,000,000.00
武汉新金投资管理有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00
荆州市古城国有投资有限责任公司		10,000,000.00		10,000,000.00
湖北银丰棉花股份有限公司		20,000,000.00		20,000,000.00
宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）		210,000,000.00		210,000,000.00



投资者名称	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
武汉光兴投资管理有限公司		5,000,000.00		5,000,000.00
武汉融景科技投资有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00
武汉中灏投资有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00
上海天阖投资合伙企业（有限合伙）		101,700,182.00		101,700,182.00
上海天涵投资合伙企业（有限合伙）		80,599,864.00		80,599,864.00
上海天霏投资合伙企业（有限合伙）		67,699,954.00		67,699,954.00
合计	2,341,130,000.00	2,320,870,000.00		4,662,000,000.00

注：2015年3月2日，经公司2015年第三次临时股东大会决议，公司本次采取非公开发行股份的方式进行增资扩股，发行股票为普通股，每股面值为人民币1元，定价为每股人民币2.2元，申请发行的股份数量为2,320,870,000股，注册资本增加2,320,870,000.00元，变更后的注册资本为人民币4,662,000,000.00元。该验资业经大信会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具大信验字[2015]第2-00059号验资报告。

（三十一）资本公积

项目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
资本溢价（注1）	263,286,255.43	2,785,044,000.00	1,716.66	3,048,328,538.77
其他资本公积（注2）		5,664,520.84	7,189,537.93	-1,525,017.09
合计	263,286,255.43	2,790,708,520.84	7,191,254.59	3,046,803,521.68

注1：2015年资本溢价增加主要系本期增资所致；本期资本溢价减少主要系收购子公司天风期货股份有限公司少数股权所致。

注2：2015年其他资本公积增加主要系股东捐赠以及公司子公司股权激励确认资本公积所致；本期其他资本公积减少系权益法核算的被投资单位资本公积变化我方按所持股权比例计算的应享有的份额确认所致。

（三十二）其他综合收益

项目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
可供出售金融资产公允价值变动损益	39,623,852.96	167,670,888.29		207,294,741.25
权益法核算的在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额		2,951,922.68		2,951,922.68
合计	39,623,852.96	170,622,810.97		210,246,663.93

（三十三）盈余公积

项目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
法定盈余公积	32,981,563.43	81,819,213.94		114,800,777.37
合计	32,981,563.43	81,819,213.94		114,800,777.37

注：根据《公司法》和公司章程的规定，公司按弥补亏损后税后利润的10%提取法定盈余公积金



(三十四) 一般风险准备

项 目	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
一般风险准备	40,987,807.90	81,819,213.94		122,807,021.84
交易风险准备	40,987,807.90	81,819,213.94		122,807,021.84
合 计	81,975,615.80	163,638,427.88		245,614,043.68

注：根据《证券法》和公司章程的规定，公司按弥补亏损后税后利润的10%提取风险准备金。

(三十五) 未分配利润

项 目	期末余额	期初余额
上年年末余额	213,298,385.33	67,447,705.16
加：年初未分配利润调整数		
本年年初余额	213,298,385.33	67,447,705.16
本期增加数	937,586,413.65	207,746,164.65
其中：本期归属于母公司股东的净利润	937,586,413.65	207,746,164.65
其他增加		
本期减少数	245,457,641.82	61,895,484.48
其中：提取法定盈余公积	81,819,213.94	20,631,828.16
提取一般风险准备	81,819,213.94	20,631,828.16
提取交易风险准备	81,819,213.94	20,631,828.16
对所有 者（或股东）的分配		
其他减少		
本期期末余额	905,427,157.16	213,298,385.33
其中：董事会已批准的现金股利数		

(三十六) 手续费及佣金净收入

项 目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入：		
1.经纪业务收入	573,027,490.61	224,549,350.15
其中：证券经纪业务	525,244,761.15	162,097,725.89
其中：代理买卖证券业务	468,850,769.76	157,414,064.42
交易单元席位租赁	31,227,994.01	3,599,212.04
代销金融产品业务	25,165,997.38	1,084,449.43
期货经纪业务	47,782,729.46	62,451,624.26



项 目	本期发生额	上期发生额
2.投资银行业务收入	614,920,857.83	180,002,637.15
其中：证券承销业务	457,907,666.00	93,579,500.00
保荐服务业务	10,710,989.00	1,200,000.00
财务顾问业务	146,302,202.83	85,223,137.15
3.投资咨询服务收入	193,445,092.23	196,269,344.31
4.资产管理业务收入	164,580,314.71	44,760,938.57
5.其他	36,579,991.02	6,330,866.41
手续费及佣金收入小计	1,582,553,746.40	651,913,136.59
手续费及佣金支出：		
1.经纪业务支出	6,204,861.27	360,114.61
其中：证券经纪业务支出	6,204,861.27	360,114.61
其中：代理买卖证券业务	6,204,861.27	360,114.61
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
期货经纪业务支出		
2.投资银行业务支出		
其中：证券承销业务		
保荐业务服务		
财务顾问业务支出		
3.投资咨询业务		
4.资产管理业务		
5.其他	264,545.39	923,965.45
手续费及佣金支出小计	6,469,406.66	1,284,080.06
手续费及佣金净收入	1,576,084,339.74	650,629,056.53

1、代销金融产品业务

项 目	本期发生额		上期发生额	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	4,273,757,825.73	24,535,808.34	62,608,704.56	685,164.71
信托	65,800,000.00	240,600.00	400,000,000.00	399,284.72
资产管理产品	31,900,000.00	389,589.04		
合 计	4,371,457,825.73	25,165,997.38	462,608,704.56	1,084,449.43

2、财务顾问业务净收入情况

项 目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	27,500,000.00	18,100,000.00



项 目	本期发生额	上期发生额
融资财务顾问业务净收入	10,605,843.05	49,488,487.15
其他财务顾问业务净收入	108,196,359.78	17,634,650.00
合 计	146,302,202.83	85,223,137.15

3、资产管理业务开展及收入情况

项 目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	合计
期末产品数量	672.00	100.00	772.00
期末客户数量	7,095.00	100.00	7,195.00
其中：个人客户	204.00	90.00	294.00
机构客户	6,891.00	10.00	6,901.00
期初受托资金	3,062,371,609.74	23,746,939,304.66	26,809,310,914.40
其中：自有资金投入	225,687,918.15		225,687,918.15
个人客户	1,263,582,074.59	201,870,000.00	1,465,452,074.59
机构客户	1,573,101,617.00	23,545,069,304.66	25,118,170,921.66
期末受托资金	45,983,841,295.18	35,972,125,182.32	82,027,938,905.19
其中：自有资金投入	686,398,841.05		667,535,318.36
个人客户	3,752,493,727.57	649,200,000.00	4,318,141,396.17
机构客户	41,544,948,726.56	35,322,925,182.32	77,042,262,190.66
期末主要受托资产的初始成本	44,880,746,313.69	35,973,968,304.94	80,854,714,618.63
其中：股票	650,079,750.62	283,813,044.37	933,892,794.99
债券	12,475,002,782.73	1,991,396,130.00	14,466,398,912.73
基金	3,823,330,580.48	601,463,387.19	4,424,793,967.67
信托	303,899,200.00	3,487,300,000.00	3,791,199,200.00
协议或定期存款	53,587,083.38	1,000,000.00	54,587,083.38
委贷		2,601,948,600.00	2,601,948,600.00
基金专户理财	10,724,156,934.73	311,950,000.00	11,036,106,934.73
期货保证金	146,049,201.00		146,049,201.00
买入返售金融资产	551,927,474.28		551,927,474.28
卖出回购金融资产款	-2,560,912,757.59	-619,996,307.00	-3,180,909,064.59
收益权		7,214,763,554.71	7,214,763,554.71
债权类资产		9,712,706,927.68	9,712,706,927.68
股票质押式回购	500,000,000.00	6,789,049,790.91	7,289,049,790.91
集合资产管理计划	16,645,368,543.27		16,645,368,543.27
其他	1,568,257,520.79	3,598,573,177.08	5,166,830,697.87
当期资产管理业务净收入	128,633,200.17	35,947,114.54	164,580,314.71



(三十七) 利息净收入

项 目	本期发生额	上期发生额
利息收入		
1.拆出资金利息收入		
2.买入返售金融资产利息收入	546,617,778.83	203,950,845.79
3.存放金融同业利息收入	130,256,493.58	42,907,093.20
4. 融资融券利息收入	169,940,621.15	38,948,571.51
5.其他流动资产/其他非流动资产利息收入	109,776,464.58	47,112,254.74
6.其他利息收入	5,514,207.34	1,395,833.33
利息收入小计	962,105,565.48	334,314,598.57
利息支出		
1.客户资金存款利息支出	16,045,948.57	3,420,730.74
2.卖出回购金融资产利息支出	539,691,518.01	181,401,503.67
3.拆入资金利息支出	36,189,490.48	11,380,361.09
其中：转融通利息支出	34,000,668.80	9,713,472.21
4. 债券、短期融资券及收益凭证利息支出	270,168,698.37	43,789,572.60
5.其他流动负债/其他非流动负债利息支出	27,472,670.71	12,586,702.55
6.其他利息支出	1,311,646.75	
利息支出小计	890,879,972.89	252,578,870.65
利息净收入	71,225,592.59	81,735,727.92

(三十八) 投资收益

项 目	本期发生额	上期发生额
1.权益法确认的收益	18,470,947.71	-1,693,554.51
2.金融工具持有期间取得的分红和利息	443,242,202.75	158,356,525.12
其中：交易性金融资产	352,565,335.13	147,071,128.55
持有至到期投资		517,315.68
可供出售金融资产	90,676,867.62	10,768,080.89
3.处置收益	834,786,564.17	131,020,564.47
其中：交易性金融资产	869,958,464.67	108,703,590.09
持有至到期投资		251,702.59
可供出售金融资产	80,437,402.25	7,082,788.44
衍生金融工具	-115,970,942.02	13,666,278.82
长期股权投资	361,639.27	1,316,204.53
4.流动资产/非流动资产产生的投资收益	3,843,643.93	2,059,835.56
合 计	1,300,343,358.56	289,743,370.64



(三十九) 公允价值变动收益

产生来源	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产公允价值变动损益	265,047,375.28	83,271,184.17
交易性金融负债公允价值变动损益	1,312,886.02	-1,312,886.02
衍生金融工具公允价值变动损益	1,548,134.45	2,522,425.42
合 计	267,908,395.75	84,480,723.57

(四十) 其他业务收入

项 目	本期发生额	上期发生额
出租收入	5,884,165.68	5,530,184.00
其他	1,785,664.00	
合 计	7,669,829.68	5,530,184.00

(四十一) 营业税金及附加

项 目	本期发生额	上期发生额
营业税	150,764,435.79	51,416,882.88
城建税	10,674,095.41	3,631,468.60
教育费附加及地方教育费附加	7,667,445.12	2,603,979.46
其他	1,546,682.70	721,602.45
合 计	170,652,659.02	58,373,933.39

(四十二) 业务及管理费

项 目	本期发生额	上期发生额
业务及管理费	1,728,109,830.77	764,093,104.74
其中：		
职工薪酬	1,097,585,765.26	318,556,170.44
租赁费	53,424,370.47	38,866,900.15
折旧与摊销	50,305,653.20	52,391,990.61
数据通讯费及电子设备运转费	36,373,000.09	20,454,522.10
差旅费	42,102,290.98	22,457,855.12
业务招待费	29,990,822.59	15,450,825.90
咨询费、顾问费、中介机构服务费	191,903,735.80	177,844,400.27
投资者保护基金	42,823,243.29	6,421,203.49
业务宣传费	37,111,221.12	13,546,482.59
佣金支出	22,627,726.83	34,627,147.70
其他	123,862,001.14	63,475,606.37



(四十三) 资产减值损失

项目	本期发生额	上期发生额
坏账损失	3,018,289.56	3,762,611.58
固定资产减值损失		3,533,877.50
应收利息减值损失	778,492.60	
其他流动资产减值损失	20,845,000.00	
融出资金减值损失	4,875,824.52	
买入返售金融资产减值损失	9,711,461.17	
合计	39,229,067.85	7,296,489.08

(四十四) 营业外收入

1. 营业外收入明细

项目	本期发生额		上期发生额	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	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	599,928.46	599,928.46	8,758.98	8,758.98
其中：固定资产处置利得	599,928.46	599,928.46	8,758.98	8,758.98
政府补助	6,150,323.00	6,150,323.00	1,991,545.00	1,991,545.00
其他	1,255,054.20	1,255,054.20	960,602.47	960,602.47
合计	8,005,305.66	8,005,305.66	2,960,906.45	2,960,906.45

2. 政府补助明细

项目	本期发生额	上期发生额	与资产相关/与收益相关
湖北财政厅金融奖励		160,000.00	与收益相关
武汉东湖开发区财政局经济贡献奖		150,000.00	与收益相关
上海财政局税收返还款		346,000.00	与收益相关
职工培训补贴		27,045.00	与收益相关
省债券融资奖励扶持专项资金	200,000.00	200,000.00	与收益相关
武汉东湖新技术开发区管理委员会财政局企业落户奖励		849,800.00	与收益相关
武汉东湖新技术开发区管理委员会财政局专项资金支持	1,675,310.00	258,700.00	与收益相关
2013年度武汉市地方金融企业财务报表综合先进单位奖励	200,000.00		与收益相关
2014年资本市场发展专项资金	200,000.00		与收益相关



项 目	本期发生额	上期发生额	与资产相关/与收益相关
2015年西安市鼓励上市企业发展专项资金	200,000.00		与收益相关
2015年大连市财政局下半年企业上市补贴资金	800,000.00		与收益相关
财政局税收返还款	282,000.00		与收益相关
浦东新区促进金融业发展的财政扶持资金	1,646,000.00		与收益相关
失业保险稳岗补贴	10,013.00		与收益相关
武汉东湖新技术开发区管委会给予的股权 投资类企业股权投资风险补贴	620,000.00		与收益相关
武汉东湖新技术开发区管委会给予的股权 投资类企业股权投资奖励	317,000.00		与收益相关
合 计	6,150,323.00	1,991,545.00	

(四十五) 营业外支出

项 目	本期发生额		上期发生额	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	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	11,463,740.53	11,463,740.53	258,808.56	258,808.56
其中：固定资产处置损失	11,463,740.53	11,463,740.53	258,808.56	258,808.56
对外捐赠	1,284,000.00	1,284,000.00	751,821.00	751,821.00
其他	25,324.92	25,324.92	531,852.79	531,852.79
合 计	12,773,065.45	12,773,065.45	1,542,482.35	1,542,482.35

(四十六) 所得税费用

1、所得税费用明细

项 目	本期发生额	上期发生额
按税法及相关规定计算的当期所得税	230,908,370.92	44,973,725.20
递延所得税费用	45,220,812.22	19,323,335.49
合 计	276,129,183.14	64,297,060.69

2、会计利润与所得税费用调整过程

项 目	本期发生额	上期发生额
利润总额	1,277,303,551.01	280,399,301.63
按法定/适用税率计算的所得税费用	319,325,887.75	70,099,825.41
子公司适用不同税率的影响	-1,948,506.35	-10,009,635.35
调整以前期间所得税的影响	49,686.53	



2015年1月1日—2015年12月31日

项 目	本期发生额	上期发生额
不征税、免税收入	-51,672,908.92	-21,120,180.89
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	3,879,422.05	3,369,204.86
权益法核算的投资收益	-4,617,736.93	423,388.63
其他	11,113,339.01	21,534,458.03
所得税费用	276,129,183.14	64,297,060.69

(四十七) 现金流量表项目注释

项 目	本期发生额	上期发生额
收到的其他与经营活动有关的现金	2,273,724,041.52	378,933,291.07
其中：收财政补贴收入	6,150,323.00	1,991,545.00
收到的其他往来款	2,267,573,718.52	376,941,746.07
支付的其他与经营活动有关的现金	1,966,148,268.29	1,857,067,539.06
其中：现金支付的业务及管理费用	473,465,213.87	409,267,144.00
支付的投资者保护基金	5,689,010.77	4,610,412.90
捐赠支出	1,284,000.00	751,821.00
支付其他往来款	1,297,745,256.55	1,375,837,240.63
支付的存出保证金	187,964,787.10	66,600,920.53
收到的其他与投资活动有关的现金	14,000,000.00	42,000,000.00
其中：处置固定资产、无形资产收到的现金	14,000,000.00	42,000,000.00

(四十八) 现金流量表补充资料

1、现金流量表补充资料

项 目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	1,001,174,367.87	216,102,240.94
加：资产减值准备	39,229,067.85	7,296,489.08
固定资产及投资性房地产折旧	21,185,152.08	20,069,713.35
无形资产摊销	15,310,582.50	12,935,445.15
长期待摊费用摊销	17,586,169.90	22,812,027.51
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）	10,863,812.07	250,049.58
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）	-267,908,395.75	-84,480,723.57
利息支出	270,168,698.37	43,789,572.60
投资损失（收益以“-”号填列）	-152,725,642.04	-289,743,370.64



项 目	本期发生额	上期发生额
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-8,537,649.56	1,257,113.07
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	53,758,461.78	18,066,222.42
交易性金融资产等的减少（增加以“-”号填列）	-5,346,678,863.95	-1,848,409,641.48
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	2,535,647,274.49	-5,210,655,586.93
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-415,416,025.44	6,073,713,573.43
其他	-	-
经营活动产生的现金流量净额	-2,226,342,989.83	-1,016,996,875.49
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	7,202,832,551.18	2,931,072,850.47
减：现金的年初余额	2,931,072,850.47	1,678,153,855.01
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加额	4,271,759,700.71	1,252,918,995.46

2. 现金及现金等价物

项 目	本期发生额	上期发生额
一、现金	7,202,832,551.18	2,931,072,850.47
其中：库存现金	1,099,545.66	566,538.18
可随时用于支付的银行存款	5,387,630,421.41	2,013,766,386.91
可随时用于支付的其他货币资金	7,850,078.74	
结算备付金	1,806,252,505.37	916,739,925.38
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、年末现金及现金等价物余额	7,202,832,551.18	2,931,072,850.47
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

(四十九) 所有权或使用权受到限制的资产

项 目	期末账面价值	受限原因
存出保证金	113,967,744.02	转融通担保物
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	3,702,600,832.25	卖出回购担保物
可供出售金融资产	43,000,000.00	其他流动负债担保物



2015年1月1日—2015年12月31日

项 目	期末账面价值	受限原因
融出资金	1,369,997,110.07	卖出回购担保物
买入返售金融资产	5,898,854,816.23	卖出回购担保物
合 计	11,128,420,502.57	—

六、合并范围的变更

(一) 报告期发生的非同一控制下企业合并情况

1、合并交易基本情况

被购买方名称	股权取得时点	股权取得成本	股权取得比例 (%)	股权取得方式	购买日	购买日的确定依据	购买日至期末被购买方的收入	购买日至期末被购买方的净利润
北京金盛博基资产管理有限公司	2015年7月	15,000,000.00	30.00	现金购买股权	2015年7月	根据企业会计准则对购买日的规定	5,000,927.94	271,215.44

2、合并成本及商誉

合并成本	北京金盛博基资产管理有限公司
现金	15,000,000.00
合并成本合计	15,000,000.00
减：取得的可辨认净资产公允价值份额	12,960,280.54
商誉	2,039,719.46

注：本公司以支付的对价人民币 15,000,000.00 元为合并成本，在合并中取得北京金盛博基资产管理有限公司 30.00% 权益，北京金盛博基资产管理有限公司可辨认净资产在购买日的公允价值为人民币 43,200,935.13 元，其中归公司享有的份额为人民币 12,960,280.54 元，两者的差额人民币 2,039,719.46 元确认为商誉。

3、被购买方于购买日可辨认资产、负债

公司名称	北京金盛博基资产管理有限公司	
	购买日公允价值	购买日账面价值
资产总额：	47,215,048.90	47,215,048.90
其中：流动资产	24,704,008.54	24,704,008.54
可供出售金融资产	22,000,000.00	22,000,000.00
固定资产	511,040.36	511,040.36
无形资产		
长期待摊费用		
负债总额：	4,014,113.77	4,014,113.77
其中：流动负债	4,014,113.77	4,014,113.77



(二) 报告期合并范围发生变化的其他原因

1、 报告期合并范围增加情况

2015年1月，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司天风天睿汇盈（武汉）投资管理有限公司设立全资子公司叶海睿德成都投资管理有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年2月，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的设立控股子公司杭州财悦科技有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年3月，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司设立控股子公司天风睿通（武汉）投资管理有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年4月，本公司全资子公司天风天盈投资有限公司设立控股子公司武汉贝壳数据服务有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年5月，本公司控股子公司天风期货股份有限公司设立全资子公司深圳天风天成资产管理有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年8月，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的设立控股子公司天风睿金（武汉）投资基金管理有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年11月，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的设立全资子公司武汉天阔投资有限公司，本公司2015年合并范围由此增加；

2015年，本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司天风天睿汇盈（武汉）投资管理有限公司设立武汉天慧瑞源投资管理合伙企业（有限合伙）、武汉天慧瑞泽投资管理合伙企业（有限合伙）、汇风盈嘉（武汉）创业投资中心（有限合伙）、天风汇德（武汉）投资中心（有限合伙）、成都汇风睿嘉投资管理合伙企业（有限合伙）、天风瑞祺（武汉）投资中心（有限合伙）、汇盈瑞信（武汉）投资中心（有限合伙）、汇盈博瑞（武汉）投资中心（有限合伙）、汇风盈创（武汉）创业投资中心（有限合伙）、汇盈通祺（武汉）投资中心（有限合伙）、盈风万润深圳创业投资中心（有限合伙）、天风瑞博（武汉）投资中心（有限合伙）、天风瑞熙深圳创业投资中心（有限合伙）、天睿汇盈天润（武汉）投资基金合伙企业（有限合伙）、汇盈通达（武汉）投资中心（有限合伙）、天风汇博（武汉）投资中心（有限合伙）、成都汇风睿德投资管理合伙企业（有限合伙）、汇盈博润（武汉）投资中心（有限合伙）、汇盈博信（武汉）投资中心（有限合伙）、汇盈博源（武汉）投资中心（有限合伙）、汇盈昇达（武汉）投资中心（有限合伙）、天风汇城（武汉）投资中心（有限合



伙)并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加;

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司天风天睿汇盈(武汉)投资管理有限公司设立的全资子公司叶海睿德成都投资管理有限公司本期设立武汉天慧瑞达投资管理合伙企业(有限合伙)、叶海睿德壹号成都创业投资中心(有限合伙)并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司睿信资本(武汉)投资管理有限公司设立武汉天风睿盈投资中心(有限合伙)并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司设立的控股子公司天风睿通(武汉)投资管理有限公司设立天风睿合(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿源(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿泽(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿翼(武汉)投资中心(有限合伙)、武汉天风睿德投资中心(有限合伙)、天风睿华(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿利(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿兴(武汉)投资中心(有限合伙)、天风睿维(武汉)投资中心(有限合伙)、睿金众合(武汉)股权投资中心(有限合伙)并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司设立控股子公司天风睿通(武汉)投资管理有限公司设立睿金众合(武汉)股权投资中心(有限合伙)设立的武汉天风智信投资中心(有限合伙))并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司长瑞当代资本管理有限公司设立控股子公司武汉长瑞圣安投资管理有限公司,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司的控股子公司长瑞当代资本管理有限公司的控股子公司武汉长瑞圣安投资管理有限公司设立武汉长瑞新兴投资中心(有限合伙)并担任普通合伙人,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天睿投资有限公司设立全资子公司天风天睿置业(武汉)有限公司,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司全资子公司天风天盈投资有限公司设立控股子公司荆州天盈投资管理有限公司,本公司2015年合并范围由此增加。

2015年,本公司设立天风创新投资股份有限公司,本公司2015年合并范围由此增加。

2、报告期合并范围减少情况



2015年，武汉天盈惠德投资中心（有限合伙）、武汉天盈惠信投资中心（有限合伙）和武汉天盈智泽投资中心（有限合伙）已清算完毕，公司不再对其控制，本公司2015年合并范围由此减少。

2015年8月，本公司全资子公司天风天盈投资有限公司处置武汉天盈博广投资中心（有限合伙）和武汉天盈博强投资中心（有限合伙）的股权，公司不再对其控制，本公司2015年合并范围由此减少。

3、报告期新纳入合并范围的主体

公司名称	期末净资产	本年净利润
武汉贝壳数据服务有限公司	-2,757,530.77	-7,757,530.77
深圳天风天成资产管理有限公司	96,421,288.44	40,062,370.79
杭州财悦科技有限公司	25,540,170.16	-4,459,829.84
天风睿通（武汉）投资管理有限公司	12,018,332.74	2,018,332.74
武汉天慧瑞源投资管理合伙企业（有限合伙）	227,144,864.95	16,650,741.18
武汉天慧瑞泽投资管理合伙企业（有限合伙）	43,184,261.91	-15,738.09
汇风盈嘉（武汉）创业投资中心（有限合伙）	49,079,181.49	-345,818.51
成都汇风睿嘉投资管理合伙企业（有限合伙）	71,761,764.09	361,764.09
天风汇德（武汉）投资中心（有限合伙）	40,079,735.03	-20,264.97
叶海睿德成都投资管理有限公司	-708,196.74	-908,196.74
武汉天慧瑞达投资管理合伙企业（有限合伙）	76,370,481.87	21,170,481.87
叶海睿德壹号成都创业投资中心（有限合伙）	129,114,750.29	27,337,213.40
武汉天风睿盈投资中心（有限合伙）	404,504,667.39	1,504,667.39
天风睿合（武汉）投资中心（有限合伙）	687,509,357.36	-9,593,252.64
天风睿源（武汉）投资中心（有限合伙）	150,064,227.83	64,227.83
天风创新投资股份有限公司	6,000,000.00	0.00
天风睿泽(武汉)投资中心(有限合伙)	50,130,341.74	5,341.74
天风睿翼(武汉)投资中心(有限合伙)	50,074,866.56	-25,133.44
天风睿金(武汉)投资基金管理有限公司	19,141,976.60	-858,023.40
睿金众合（武汉）股权投资中心（有限合伙）	9,994,975.00	-5,025.00
武汉天风智信投资中心（有限合伙）	1,199,399,285.00	-600,715.00
天风瑞祺（武汉）投资中心（有限合伙）	20,039,641.03	-10,358.97
汇盈瑞信（武汉）投资中心（有限合伙）	999,619.72	-380.28
汇盈博瑞（武汉）投资中心（有限合伙）	138,351,531.24	6,143,531.24
汇风盈创（武汉）创业投资中心（有限合伙）	25,087,829.54	-12,170.46
汇盈通祺（武汉）投资中心（有限合伙）	30,034,810.46	-15,189.54
盈风万润深圳创业投资中心（有限合伙）	55,345,243.04	948,743.04
天风瑞博（武汉）投资中心（有限合伙）	14,999,610.00	-390.00



公司名称	期末净资产	本年净利润
天风瑞熙深圳创业投资中心（有限合伙）	99,100,000.00	0.00
天睿汇盈天润（武汉）投资基金合伙企业（有限合伙）	-340.00	-340.00
汇盈通达（武汉）投资中心（有限合伙）	-340.00	-340.00
天风汇博（武汉）投资中心（有限合伙）	-340.00	-340.00
成都汇风睿德投资管理合伙企业（有限合伙）	12,497,412.00	-2,588.00
武汉天阔投资有限公司	9,893,204.23	-106,795.77
武汉天风睿德投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风睿华（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风睿利（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风睿兴（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风睿维（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
汇盈博润（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
汇盈博信（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
汇盈博源（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
汇盈昇达（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风汇城（武汉）投资中心（有限合伙）	0.00	0.00
天风天睿置业（武汉）有限公司	0.00	0.00
荆州天盈投资管理有限公司	0.00	0.00
武汉长瑞圣安投资管理有限公司	999,963.00	-37.00
武汉长瑞新兴投资中心（有限合伙）	51,999,490.00	-510.00

七、在其他主体中的权益

（一）在子公司中的权益

1、企业集团的构成

子公司名称	注册地	主要经营地	业务性质	持股比例（%）	取得方式
天风期货股份有限公司（原名：天风期货有限公司）	辽宁大连	辽宁大连	商品期货、金融期货经纪、期货投资咨询	98.63	设立
天风天盈投资有限公司	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询	100.00	设立
天风天睿投资有限公司	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询	100.00	设立
天风创新投资股份有限公司	上海市	上海市	实业投资、投资管理及咨询	75.00	设立
天风天信财富投资管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	受金融机构委托从事银行业务流程、信息技术外包服务；投资管理	65.00	设立
武汉贝壳数据服务有限公司	湖北武汉	湖北武汉	网络支付系统及金融软件的技术开发	99.90	设立
深圳天风天成资产管理有限公司	深圳	深圳	资产管理等	100.00	设立



子公司名称	注册地	主要经营地	业务性质	持股比例 (%)	取得方式
天风天财(武汉)金融信息服务 服务有限公司	湖北武汉	湖北武汉	金融信息服务	72.86	设立
杭州天悦科技有限公司	浙江杭州	浙江杭州	软件开发, 网络数据处理	51.00	设立
睿信资本(武汉)投资管理有 限公司	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询	60.00	设立
天风天睿汇盈(武汉)投资管 理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	股权投资及咨询	65.00	设立
天风睿通(武汉)投资管理有 限公司	湖北武汉	湖北武汉	股权投资及咨询	65.00	设立
叶海睿德成都投资管理有限公 司	四川成都	四川成都	投资管理及财务咨询	90.00	设立
武汉长瑞圣安投资管理有限公 司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资及股权投资	51.00	设立
武汉光谷创投基金管理有限公 司	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询	55.00	非同一控制下 企业合并
长瑞当代资本管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	资产管理、投资管理、投资咨询	51.00	非同一控制下 企业合并
北京金盛博基资产管理有限公 司	北京	北京	资产管理、投资管理及咨询	66.00	非同一控制下 企业合并
天风睿金(武汉)投资基金管理 有限公司	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资及咨询	60.00	设立
武汉天阔投资有限公司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等	100.00	设立
荆州天盈投资管理有限公司	湖北荆州	湖北荆州	实业投资、项目投资、投资咨询等	51.00	设立
天风天睿置业(武汉)有限公 司	湖北武汉	湖北武汉	物业管理、装饰装修工程等	100.00	设立
武汉达昇创业投资中心(有限 合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及咨询		结构化主体
武汉泰德鑫创业投资中心(有 限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
武汉惠人生物创业投资基金中 心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资及咨询		结构化主体
天风汇盈壹号(武汉)创业投 资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资及咨询		结构化主体
武汉洪广汇利投资管理合伙企 业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
武汉天慧瑞源投资管理合伙企 业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理		结构化主体
武汉天慧瑞泽投资管理合伙企 业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理		结构化主体
天慧瑞德(武汉)创业投资中 心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资		结构化主体
汇风盈嘉(武汉)创业投资中 心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理		结构化主体
成都汇风睿德投资管理合伙企 业(有限合伙)	四川成都	四川成都	投资与资产管理		结构化主体
成都汇风睿嘉投资管理合伙企 业(有限合伙)	四川成都	四川成都	投资与资产管理		结构化主体
天风汇德(武汉)投资中心(有 限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
武汉天慧瑞达投资管理合伙企 业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理		结构化主体



子公司名称	注册地	主要经营地	业务性质	持股比例 (%)	取得方式
叶海睿德壹号成都创业投资中心(有限合伙)	四川成都	四川成都	创业投资业务; 投资与资产管理。		结构化主体
武汉天风睿信资本投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
恒泰睿信(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
武汉睿沅资本投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
武汉天风睿盈投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
天风睿合(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
天风睿源(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资管理及咨询		结构化主体
武汉天盈博仁投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	股权投资、资产管理等		结构化主体
武汉天盈博学投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
武汉天盈惠礼投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
武汉天盈惠义投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
武汉天盈惠智投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿泽(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿翼(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
睿金众合(武汉)股权投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
武汉天风智信投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风瑞祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
汇盈瑞信(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资及投资咨询		结构化主体
汇盈博瑞(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
汇风盈创(武汉)创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
汇盈通祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
盈风万润深圳创业投资中心(有限合伙)	深圳	深圳	投资管理及咨询		结构化主体
天风瑞博(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
天风瑞熙深圳创业投资中心(有限合伙)	深圳	深圳	投资管理及咨询		结构化主体
天睿汇盈天润(武汉)投资基金合伙企业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资与受托固定资产管理		结构化主体
汇盈通达(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体



子公司名称	注册地	主要经营地	业务性质	持股比例 (%)	取得方式
天风汇博(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
武汉天风睿德投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿华(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿利(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿兴(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
天风睿维(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
汇盈博润(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
汇盈博信(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
汇盈博源(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		结构化主体
汇盈昇达(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
天风汇城(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询		结构化主体
武汉长瑞新兴投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	项目投资;股权投资;		结构化主体
若干证券公司及资产管理公司资产管理计划	上海	上海	证券投资		结构化主体

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

本公司发行及管理的纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司发行的资产管理计划及特定客户资产管理计划。本公司作为资产管理计划管理人考虑对该等结构化主体是否存在控制，并基于本公司作为资产管理人的决策范围、资产管理计划持有人的权力、提供管理服务而获得的报酬和面临的可变动收益风险敞口等因素来判断本公司作为资产管理计划管理人是主要责任人还是代理人。经评估后，本公司承担主要责任人的资产管理计划纳入合并范围。

2、重要的非全资子公司情况

序号	公司名称	2015年度			
		少数股东持股比例	当期归属于少数股东的损益	当期向少数股东支付的股利	期末累计少数股东权益
1	天风期货股份有限公司	1.37%	660,948.62		2,984,726.62

3、重要的非全资子公司主要财务信息

子公司名称	2015年12月31日		2014年12月31日	
	资产合计	负债合计	资产合计	负债合计
天风期货股份有限公司	1,334,180,227.81	1,116,316,971.03	953,109,001.71	817,146,089.59



子公司名称	2015年度			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
天风期货股份有限公司	161,242,620.93	47,824,754.69	49,500,344.66	-3,164,543.60

子公司名称	2014年度			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
天风期货股份有限公司	94,777,101.80	2,156,473.56	2,456,676.49	57,636,874.84

(二) 报告期子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

1、 在子公司所有者权益份额发生变化的情况说明

2015度，公司以3,240.00万元人民币的价格增资天风期货股份有限公司（以下简称“天风期货”），本次增资完成后公司持有天风期货98.63%的股权。

2、 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响

交易年度	2015年度
项目	天风期货
购买成本/处置对价	32,400,000.00
其中：现金	32,400,000.00
购买成本/处置对价合计	32,400,000.00
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	32,398,283.34
差额	1,716.66
其中：调整资本公积	-1,716.66

(三) 在合营企业或联营企业中的权益

1、 重要联营企业基本情况

公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例（%）		投资的会计处理方法
				直接	间接	
宜宾市商业银行股份有限公司（注）	四川宜宾	四川宜宾	商业银行	14.57		权益法

注：持有20%以下表决权但具有重大影响的依据为在宜宾市商业银行股份有限公司派驻一名董事。



2、重要联营企业的主要财务信息

项 目	2015年12月31日/2015年度
	宜宾市商业银行股份有限公司
资产合计	29,224,552,658.19
负债合计	25,770,642,434.42
少数股东权益	259,446,554.78
归属于母公司股东权益	3,194,463,668.99
按持股比例计算的净资产份额	465,433,356.57
调整事项	75,314,431.84
其中：商誉	75,314,431.84
对联营企业权益投资的账面价值	540,747,788.41
营业收入	974,296,957.89
净利润	346,883,293.06
其他综合收益	49,458,295.63
综合收益总额	396,341,588.69
本年度收到的来自联营企业的股利	17,488,350.00

3、不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

项 目	2015年12月31日/2015年度	2014年12月31日/ 2014年度
一、合营企业		
投资账面价值合计	645,585.50	1,132,539.30
下列各项按持股比例计算的合计数：		
净利润	-486,953.80	-367,460.7
其他综合收益	0.00	0.00
综合收益总额	-486,953.80	-367,460.70
二、联营企业		
投资账面价值合计	603,811,536.40	56,673,906.19
下列各项按持股比例计算的合计数：		
净利润	5,204,575.34	-1,326,093.81
其他综合收益	21,029.44	0.00
综合收益总额	5,225,604.78	-1,326,093.81

4、合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力不存在重大限制。

(四) 未纳入合并财务报表范围的结构化主体情况

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本公司发起设立的



投资基金和资产管理计划，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。本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。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项 目	2015年12月31日		2014年12月31日	
	账面价值	最大损失敞口	账面价值	最大损失敞口
集合资产管理计划	1,374,572,262.61	1,374,572,262.61	275,859,534.47	275,859,534.47

注：集合资产管理计划列示在财务报表中的“可供出售金融资产”项目中，最大损失敞口为集合资产管理计划在资产负债表日的账面价值（公允价值）。

八、与金融工具相关的风险

（一）风险管理政策与组织架构

1、风险管理政策

公司风险管理秉承全面性、审慎性、合规性、独立性、制衡性、透明性、有效性及预见性原则，针对公司面临的所有风险类别，将风险管理工作覆盖公司的各个业务、岗位和部门，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，确保公司的风险管理战略与公司的经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，并与公司的长期发展目标保持一致。

公司风险管理文化为：全面、全员、主动、审慎。全面指风险管理覆盖全业务、全流程；全员指风险管理人人参与、人人有责；主动指通过经营风险、交易风险和主动管理风险实现价值最大化；审慎指公司经营以合规、稳健为前提，确保公司风险可测、可控、可承受。

公司在日常经营活动中涉及的风险主要包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险与声誉风险。公司基于稳健型的风险偏好，制定相应的制度和流程，选取适当的风险控制指标、风险限额、风险计量模型等识别和分析，运用信息系统实现动态监控，并坚持每日、每月、每年定期报告，综合管理各类风险。

2、风险管理组织架构

公司建立了全面风险管理体系，建立了由四个层级组成的风险管理组织架构。第一层级为董事会及董事会下设的风险管理委员会；第二层级为公司执行委员会及执行委员会下设的风险管理专业委员会、首席风险官；第三层级为风险管理部、合规法律部、稽核审计部、财务核算部、资金计划部、品牌管理部等风险管理部门；第四层级为各业务部门和分支机构。



公司风险管理组织架构各层级的职责和分工如下：

公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，负责制定风险管理战略和风险管理政策，确定风险管理原则，根据环境的变化和业务的发展不断检验风险管理政策的有效性以使其不断完善，并将风险管理纳入整体经营发展战略。董事会下设风险管理委员会，主要负责研究制定公司总体风险控制和风险管理政策，审查公司风险控制体系及其有效性，监控、检查公司经营管理和业务运作，审查公司内部风险控制制度的落实情况，研究制定公司重要风险的界限以及董事会赋予的其他职责。

公司执行委员会是公司全面风险管理工作的组织机构，负责在董事会授权范围内，审批公司风险限额的分配方案、各项业务的风险额度、净资本补足方案的具体实施等董事会授权事项。公司执行委员会对公司全面风险管理的有效性承担主要责任。

风险管理专业委员会是公司执行委员会下设的专门工作机构，对公司执行委员会负责并报告工作。风险管理专业委员会主要负责对公司的整体风险状况进行评估，研究确定公司风险控制指标，对公司的总体风险管理进行监督，以确保与公司经营活动相关的各种风险控制在合理的范围内。公司首席风险官负责统筹公司风险管理工作，执行风险管理专业委员会制定的风险管理政策；制定风险管理的程序和操作规程，并监督其落实；有效识别、计量、监测和控制各项业务所承担的风险；负责对风险评估报告、创新业务方案等进行审查。

公司风险管理部、合规法律部、稽核审计部是公司的专职风险管理部门，分别独立行使相应的风险管理职能，与财务核算部、资金计划部、信息技术部、品牌管理部等公司内部控制部门对公司面临的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、声誉风险等主要风险进行事前、事中和事后管理，并负责沟通协调相关的风险管理工作。公司在开展新业务、新产品、扩大现有业务规模前，由风险管理部、合规法律部与业务部门共同负责进行合规性审查及风险评估工作，综合分析最大可能的风险水平是否在公司可承受的范围内。合规法律部、风险管理部还通过审查部门业务规章制度、各种对外合同的合规性，从制度建设、风险识别等方面对各项业务的风险进行事前控制。公司在办公流程中嵌入了合规审查和风险评估节点，合规法律部和风险管理部归口人员通过对流程的处理，及时识别、评估和处理证券自营业务、资产管理业务、投资银行业务、经纪业务、融资融券、股票质押式回购交易业务、约定购回式业务、新三板做市商业务等各类业务中的风险。合规法律部、风险管理部负责分别对证券自营业务、资产管理业务、经纪业务、融资融券业务、资产管理业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式业务、新三板做市、交易类创新业务及净资本等相关风险控



制指标进行监控，对监控中发现的异常事项进行警示、上报并报送相关部门，通过实时监控
系统实现各项业务风险的事中控制，并对业务风险进行不定期评估。稽核审计部通过现场稽
核、非现场稽核、专项稽核等多种稽核方式对各项业务的合法合规性、内部控制的有效性进
行独立的内部审计，对各项业务风险进行事后控制，对公司内部控制的健全性、有效性进行
评价。

公司各业务部门及分支机构负责人为本部门风险管理的第一责任人，负责履行一线风险
管理职能，按照公司风险管理的要求，将风险管理覆盖到所有业务流程和岗位。公司各业务
部门及分支机构设立了履行合规与风险管理职责的专岗，协助本部门负责人对所开展的业
务进行风险识别、评估、管理和控制。

（二）市场风险概况及其管理

1、市场风险概况

市场风险是指因市场价格（权益类证券价格、利率、汇率或商品价格等）的不利变动而
使得公司各项业务发生损失的风险。市场风险可分为权益类价格风险、利率风险、汇率风险、
商品价格风险等，分别指由于权益类价格、利率、汇率风险、商品价格等变动而给公司带来
的风险。因投资范围受限的原因，证券公司自身所面临的市场风险主要集中在权益类价格风
险、利率风险和商品价格风险上。此外，国内场内和场外衍生品市场正处在起步阶段，相应
的市场机制还不完善，可使用的有效风险对冲工具缺乏。衍生品市场的高速发展不仅增加了
证券公司所承担的市场风险敞口，同时增加了证券公司面临的市场风险的复杂性，对证券公
司的市场风险管理提出了更大的挑战。

2、市场风险管理

风险管理部根据公司风险偏好设定公司市场风险容忍度，并通过识别、评估、计量、监
督及管理等措施，确保公司所承受的市场风险在公司设定的风险容忍度以内。公司市场风
险管理的具体措施包括：

（1）持续积极改善 VaR 风险计算模型，包括增加新开拓市场的风险因子，优化计算方
法等。同时，公司通过回溯测试等方法，对 VaR 计算模型的准确性进行持续检测。

（2）压力测试是风险测量中 VaR 计算方法重要和必须的补充工具。压力测试是公司市
场风险管理的重要组成部分，公司的压力测试分为综合压力测试与专项压力测试。在压力测
试中，公司设置了一系列宏观及市场场景，计算公司全部或特定投资组合持仓在单一情景或
多情景同时发生时的可能损失。通过压力测试，对组合持仓面临极端情况冲击下的可能损失



状况进行评估，了解单一风险因子或特定压力情景下公司的可能损失，进行风险收益分析，考察公司各项关键监管指标是否符合要求，以及对公司整体的影响是否在可承受的范围内。

报告期内，合并口径的自营投资业务按风险类别分别计量的风险价值如下：

风险来源	单日 95%VAR (单位：元人民币)	
	2015年12月31日	2014年12月31日
权益类市场风险	139,199,337.62	11,979,210.78
利率类市场风险	4,379,748.39	1,526,839.06
商品类市场风险	42,360.55	-
分散化效益	5,474,895.47	2,216,155.75
合计	138,104,190.53	11,289,894.09

(3) 利率敏感性分析

公司使用利率敏感性分析衡量在其他变量假设不变的情况下，因利率变动导致固定收益类投资损失的风险。假设市场整体利率平行变动时，固定收益类持仓的利率敏感性分析如下：

情景	利率敏感性 (单位：元人民币)	
	2015年12月31日	2014年12月31日
上升 25 个基点	-43,895,418	-13,924,390
下降 25 个基点	43,895,418	13,924,390

(三) 信用风险概况及其管理

1、信用风险概况

信用风险是指发行人、交易对手未能履行合同所规定的义务或由于信用评级的变动或履约能力的变化导致债务的市场价值变动，从而对公司造成损失的风险。公司目前面临的信用风险主要集中在债券投资业务、衍生品交易业务、融资融券业务、约定式购回业务、股票质押式回购业务等业务。随着证券行业创新业务的不断发展，公司承担的各类信用风险日趋复杂。

2、信用风险管理

公司通过有效风险识别、审慎风险评估和决策、动态风险计量和监控、风险及时报告和应对等方式，对信用风险实施全程管理，以期能有效防范或避免风险事件的发生、降低风险事件对公司造成的损失并在信用风险可以接受的范围内实现收益最大化。

报告期末，公司不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口如下：

项 目	单位：元人民币	
	期末余额	期初余额
货币资金	5,396,580,045.81	2,014,332,925.09
结算备付金	1,806,252,505.37	916,739,925.38



项 目	期末余额	期初余额
融出资金	1,620,399,012.30	1,348,829,290.40
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	8,740,190,905.94	2,917,366,787.95
衍生金融资产	1,995,954.13	4,049,710.31
买入返售金融资产	8,621,850,005.24	5,382,301,084.98
应收款项	25,909,324.82	6,965,809.76
应收利息	130,839,828.63	31,401,533.09
存出保证金	981,386,140.75	520,841,582.48
可供出售金融资产	7,571,024,639.23	1,061,138,084.47
持有至到期投资	-	-
最大信用风险敞口	34,896,428,362.22	14,203,966,733.91

（四）流动性风险

1、流动性风险概况

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。流动性风险因素及事件包括但不限于：资产负债结构不匹配、资产变现困难、经营损失、交易对手延期支付或违约，以及信用风险、市场风险、声誉风险等类别风险向流动性风险的转化等。公司将流动性视为生命线，并将流动性风险管理作为风险管理第一要务，通过持续、积极、主动的流动性管理及流动性风险识别、计量、监测及控制，及时有效防范及管理公司流动性风险。

2、流动性风险管理

公司储备了国债、央票等在极端情况下仍可随时变现的高流动性资产，以备意外支出。公司积极开展资金缺口管理，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，及早识别潜在风险，提前安排融资和调整业务用资节奏，有效管理支付风险。

（五）操作风险概况及其管理

1、操作风险概况

操作风险是指由不完善的内部程序、人员管理、系统以及外部事件所造成损失的风险。证券公司的操作风险贯穿于公司各部门及业务条线（包括前台业务部门和中后台支持部门），具有覆盖面广、种类多样的特点，既包括发生频率高、但损失相对较低的日常业务流程处理的纰漏，也包括发生频率低但会引发重大影响的突发事件，使得操作风险管理成为证券公司贯彻落实全面风险管理目标的重要一环。随着公司创新业务的不断增加、业务流程的日趋复杂，如未能及时识别各业务条线和日常经营的操作隐患并有效采取缓释措施，可能会导致公



司相关业务流程设置不清晰、未得到有效执行，或因工作人员故意或过失导致公司内控机制受到限制或失去效用，从而引发操作风险，产生财务与声誉的损失。

2、操作风险管理

公司注重制度的可操作性、标准化、设计的科学性和有效性，大力推动流程建设常态化。公司着力建设“业务控制自查、风险监控、内控稽核”的三道防线对操作风险进行管理，确保各业务线条全面覆盖、充分监督。业务部门负责所辖业务的管理制度、流程建设，管理、监控和报告各项业务和管理中的操作风险；风险管理部、合规法律部作为管理操作风险的职能部门，提供管理工具、方法，制定管理标准，综合分析报告；稽核审计部对操作风险管理、控制、监督体系进行后续监督和责任追究。

九、公允价值

1、按公允价值层级对以公允价值计量的资产进行分析

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）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	2,033,273,162.30	6,611,242,293.64	95,675,450.00	8,740,190,905.94
1. 交易性金融资产	2,033,273,162.30	6,611,242,293.64	95,675,450.00	8,740,190,905.94
（1）债务工具投资	672,920,990.80	5,530,616,852.00		6,203,537,842.80
（2）权益工具投资	1,360,352,171.50	1,080,625,441.64	95,675,450.00	2,536,653,063.14
（二）可供出售金融资产	232,925,644.98	3,954,941,469.25	631,542,775.00	4,819,409,889.23
1. 债务工具投资	-	17,844,345.00	-	17,844,345.00
2. 权益工具投资	232,925,644.98	3,937,097,124.25	631,542,775.00	4,801,565,544.23
（三）衍生金融资产		1,995,954.13		1,995,954.13
持续以公允价值计量的资产总额	2,266,198,807.28	10,568,179,717.02	727,218,225.00	13,561,596,749.30
（四）衍生金融负债				
持续以公允价值计量的负债总额				

项 目	期初公允价值			
	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）以公允价值计量且其变动计入当期	963,260,896.90	1,954,105,891.05		2,917,366,787.95



项 目	期初公允价值			
	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
损益的金融资产				
1. 交易性金融资产	963,260,896.90	1,954,105,891.05		2,917,366,787.95
(1) 债务工具投资	300,917,044.70	1,860,435,350.00		2,161,352,394.70
(2) 权益工具投资	662,343,852.20	93,670,541.05		756,014,393.25
(二) 可供出售金融资产	36,330,000.00	479,683,084.47	373,670,000.00	889,683,084.47
1. 债务工具投资		16,913,550.00		16,913,550.00
2. 权益工具投资	36,330,000.00	462,769,534.47	373,670,000.00	872,769,534.47
(三) 衍生金融资产		4,049,710.31		4,049,710.31
持续以公允价值计量的资产总额	999,590,896.90	2,437,838,685.83	373,670,000.00	3,811,099,582.73
(四) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		308,892,200.00		308,892,200.00
其中：发行的交易性债券		308,892,200.00		308,892,200.00
持续以公允价值计量的负债总额		308,892,200.00		308,892,200.00

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

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

项 目	期末公允价值	期初公允价值	估值技术	输入值
债券	5,548,461,197.00	1,877,348,900.00	现金流量折现法	债券收益率
权益工具投资	5,017,722,565.89	556,440,075.52	投资标的市价组合法	投资标的市价
衍生金融资产	1,995,954.13	4,049,710.31		
——利率互换	1,995,954.13	4,049,710.31	现金流量折现法	远期利率/折现率
合计	10,568,179,717.02	2,437,838,685.83		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		308,892,200.00	现金流量折现法	债券收益率
合计		308,892,200.00		

4、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

2015年度及2014年度本公司未将金融工具的公允价值从第一级和第二级转移到第三级，



亦未有将金融工具的公允价值于第一层级与第二层级之间转换。

5、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

本公司认为，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

十、关联方关系及其交易

(一) 第一大股东情况

公司名称	与本公司关系	注册地	法人代表	组织机构代码	业务性质	注册资本	对本公司持股比例	对本公司表决权比例
武汉国有资产经营公司	第一大股东	湖北武汉	杨国霞	17775891-7	资本投资服务	壹拾贰亿叁仟捌佰叁拾肆万元整	13.66%	13.66%

(二) 本公司子公司的情况

详见附注“七、在其他主体中的权益”。

(三) 本企业的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“七、在其他主体中的权益”，报告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

合营或联营企业名称	其他关联方与本公司关系
武汉奥多生物医药有限公司	合营企业

(四) 本企业的其他关联方情况

其他关联方名称	组织机构代码	其他关联方与本公司关系
人福医药集团股份公司	30001485-0	持股 5%以上股东
湖北省科技投资集团有限公司	77816251-0	2015 年增资前持股比例为 5.71%，增资后持股比例为 2.87%
武汉东湖高新集团股份有限公司	30001046-2	公司董事曾担任该公司董事，2012 年 11 月卸任
武汉国创金融服务有限公司	68234101-2	第一大股东武汉国有资产经营公司之子公司
武汉国创资本投资有限公司	05919646-6	第一大股东武汉国有资产经营公司之子公司
武汉高科国有控股集团有限公司	72579622-9	2015 年增资前持股比例为 6.41%，增资后持股比例为 3.22%
武汉新星汉宜化工有限公司	79466971-1	持股 5%以上股东（武汉当代科技产业集团股份有限公司）的一致行动人之子公司
湖北省担保集团有限责任公司（原名：湖	77076550-1	公司董事担任该公司董事长



其他关联方名称	组织机构代码	其他关联方与本公司关系
北中企投资担保有限公司)		
武汉当代科技产业集团股份有限公司	17806826-4	持股 5%以上股东的一致行动人
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	68234122-3	公司董事担任该公司董事
武汉三特索道集团股份有限公司	17773028-7	持股 5%以上股东（武汉当代科技产业集团股份有限公司）的一致行动人之子公司
武汉道博股份有限公司	30010058-0	持股 5%以上股东（武汉当代科技产业集团股份有限公司）的一致行动人之子公司
深圳新鹏生物工程有限公司	19221097-6	持股 5%以上股东人福医药集团股份公司之子公司
武汉当代地产开发有限公司	57493595-6	持股 5%以上股东（武汉当代科技产业集团股份有限公司）的一致行动人之子公司
武汉光谷融资租赁有限公司	59451571-3	公司董事、监事担任该公司董事
武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	68232021-1	第一大股东武汉国有资产经营公司之控股子公司
湖北中经中小企业投资有限公司	76740474-8	公司董事担任该公司董事长
黄其龙		公司董事会秘书

(五) 关联交易情况

1、提供和接受劳务的关联交易

(1) 提供劳务的关联交易

关联方名称	关联交易内容	本期发生额		上期发生额	
		金额	占同类交易金额的比例 (%)	金额	占同类交易金额的比例 (%)
人福医药集团股份公司	保荐收入	1,200,000.00	11.20		
武汉三特索道集团股份有限公司	保荐收入			1,200,000.00	100.00
湖北省科技投资集团有限公司	财务顾问收入				
武汉道博股份有限公司	财务顾问收入			5,000,000.00	5.87
武汉东湖高新集团股份有限公司	财务顾问收入				
武汉国有资产经营公司	财务顾问收入	700,000.00	0.48	1,200,000.00	1.41
武汉三特索道集团股份有限公司	财务顾问收入				
人福医药集团股份公司	证券承销收入	28,000,000.00	6.11		



关联方名称	关联交易内容	本期发生额		上期发生额	
		金额	占同类交易金额的比例(%)	金额	占同类交易金额的比例(%)
武汉道博股份有限公司	证券承销收入	9,000,000.00	1.97		
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券承销收入	10,000,000.00	2.18		
武汉三特索道集团股份有限公司	证券承销收入			11,000,000.00	11.75
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	财务顾问、咨询服务收入	5,007,053.24	1.47		
武汉国创资本投资有限公司	咨询服务收入	2,418,000.00	1.25		
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	其他-平台服务费	4,861,489.19	14.93		
武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	其他-平台服务费	398,651.47	1.22		
武汉国创资本投资有限公司	其他-平台服务费	172,106.60	0.53		
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券经纪收入			29,986.65	0.02
武汉国有资产经营公司	证券经纪收入	165,509.26	0.03	228,105.39	0.14
正隆(北京)保险经纪股份有限公司	证券经纪收入	650.48	-		
湖北银丰天睿资产管理有限公司	期货经纪收入	189,777.53	0.40		
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	证券经纪收入			2,320.00	0.00
武汉当代科技产业集团股份有限公司	利息收入-其他流动资产/其他非流动资产利息收入	1,086,111.11	0.99	1,062,500.00	2.26
武汉奥多生物医药有限公司	利息收入-其他流动资产/其他非流动资产利息收入	3,119,813.41	2.84		
武汉国创资本投资有限公司	利息收入-其他流动资产/其他非流动资产利息收入	640,000.00	0.58		
武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	利息收入-其他流动资产/其他非流动资产利息收入	19,726.03	0.02		
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	利息收入-其他流动资产/其他非流动资产利息收入	24,705,124.74	22.50	19,726.03	0.04



(2) 接受劳务的关联交易

关联方名称	关联交易内容	本期发生额		上期发生额	
		金额	占同类交易金额的比例 (%)	金额	占同类交易金额的比例 (%)
湖北省担保集团有限责任公司	担保费	4,500,000.00	2.34	1,549,000.00	16.79
武汉当代科技产业集团股份有限公司	担保费	3,500,000.00	1.82	3,000,000.00	33.57
武汉市正隆财富管理有限公司	咨询费支出	9,369.86	-		
武汉当代科技产业集团股份有限公司	利息支出-存款利息支出	5,640.65	0.04	655.71	0.02
武汉国有资产经营公司	利息支出-存款利息支出	3,297.91	0.02	9,138.17	0.27
正隆(北京)保险经纪股份有限公司	利息支出-存款利息支出	278.85	-		
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	利息支出-存款利息支出	3.91	-	3,647.81	0.11
武汉国创资本投资有限公司	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出	324,085.73	1.18		
武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出	1,227,825.00	4.47		
武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出	112,938.59	0.41		
湖北三环资本管理有限公司	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出	1,722.22	0.01		
武汉奥多生物医药有限公司	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出	3,045,916.67	11.09		

2、关联租赁情况

年度	出租方名称	承租方名称	金额	本期确认的租赁收入\支出
2015年	武汉国创金融服务有限公司	天风证券股份有限公司	1,112,411.46	本期确认的租赁支出
2015年	湖北省担保集团有限责任公司	天风证券股份有限公司	5,957,920.80	本期确认的租赁支出
2015年	深圳新鹏生物工程有限公司	天风证券股份有限公司	348,000.00	本期确认的租赁支出
2014年	武汉国创金融服务有限公司	天风证券股份有限公司	922,168.41	本期确认的租赁支出
2014年	湖北省担保集团有限责任公司	天风证券股份有限公司	4,468,440.60	本期确认的租赁支出
2014年	深圳新鹏生物工程有限公司	天风证券股份有限公司	300,000.00	本期确认的租赁支出



3、关键管理人员报酬

项目名称	本期发生额	上期发生额
实际支付关键管理人员报酬	51,292,061.55	13,069,861.64

4、关联方共同设立企业

(1) 2015年7月，关联方武汉国创资本投资有限公司与武汉天盈博学投资中心（有限合伙）签署《武汉天盈博学投资中心（有限合伙）入伙协议》，根据协议约定武汉国创资本投资有限公司承诺出资2,330.00万元作为有限合伙人入伙。2015年7月29日，武汉国创资本投资有限公司足额缴纳了出资款，该有限合伙设立时认缴资本为4,780.50万元。

(4) 2015年12月22日，公司睿金众合（武汉）股权投资中心（有限合伙）（天风天睿控股子公司天风睿通（武汉）投资管理有限公司担任其GP）作为GP与天风睿通（武汉）投资管理有限公司、关联方湖北中经中小企业投资有限公司签署《武汉天风智信投资中心（有限合伙）合伙协议》，协议约定各方认缴资本合计244,250.00万元，截至资产负债表日，关联方湖北中经中小企业投资有限公司已实际出资70,000万元。

5、向关联方购买和出售股权

(1) 2015年2月，公司子公司天风天盈投资有限公司与关联方武汉光谷科信小额贷款股份有限公司签署《合伙份额转让协议书》，天风天盈投资有限公司作为武汉天盈博广投资中心（有限合伙）的普通合伙人将其所持有的武汉天盈博广投资中心（有限合伙）0.37%的出资、对应15万元出资额以15万元的对价转让给武汉光谷科信小额贷款股份有限公司。2015年8月5日，天风天盈投资有限公司收到武汉光谷科信小额贷款股份有限公司支付的15万元股权转让款。

(2) 2015年2月，公司子公司天风天盈投资有限公司与关联方武汉光谷科信小额贷款股份有限公司签署《合伙份额转让协议书》，天风天盈投资有限公司作为武汉天盈博强投资中心（有限合伙）的普通合伙人将其所持有的武汉天盈博强投资中心（有限合伙）0.44%的出资、对应10万元出资额以10万元的对价转让给武汉光谷科信小额贷款股份有限公司。2015年8月5日，天风天盈投资有限公司收到武汉光谷科信小额贷款股份有限公司支付的10万元股权转让款。

6、关联担保

(1) 2014年3月13日，本公司与湖北中企投资担保有限公司（现已更名为湖北省担保



集团有限责任公司)签订了《委托担保合同》。合同约定,湖北中企投资担保有限公司以连带责任保证的方式为公司公开发行的公司债向债券持有人提供担保,担保的金额为人民币6亿元,担保期限为6年,担保费率为担保额的0.75%/年。2014年、2015年度公司实际发生的担保费用分别为150万元和450万元。

(2)2014年3月26日,本公司成功发行了5亿元次级债券,本公司与当代科技签订《担保合同》。合同约定,当代科技为公司本次次级债券的到期兑现承担无限连带担保责任,担保期限从本期次级债券发行之日起至全额兑现本金及利息为止,本公司每年支付本期次级债券总金额的0.65%作为担保费用。2014年、2015年度公司实际发生的担保费用分别为300万元和350万元。

7、其他关联交易

(1)2012年,公司与武汉国创金融服务有限公司签订《协议书》,约定向其购买位于武汉市江岸区香港路康怡花园1栋1-2层2室、3-9层(整层)室的房产,价格为9,000万元。公司按照《协议书》之约定于2012年6月向国创金融支付了全额价款。由于该房产为国创金融与武汉市国资委资产置换所得,《协议书》签订之时,该房产仍登记在武汉市国资委名下,武汉市国资委于2012年9月8日将该房产移交给公司实际占有并使用。因该房产迟迟未能过户至公司名下,2014年12月至2015年1月期间国创金融将公司已陆续将公司支付的9,000万元转让价款全额返还给公司。

2014年12月10日起香港路房产在武汉光谷联合产权交易所以9,000万元的价格挂牌转让,挂牌期间只产生天风天睿投资有限公司一个意向受让方。2015年1月12日,天风天睿投资有限公司与国创金融签订《湖北省实物资产转让产权交易合同》,天风天睿投资有限公司以9,000万元的价格受让取得香港路房产。2015年3月16日,该房产过户至天风天睿投资有限公司名下。

(2)2012年,公司与武汉当代科技集团股份有限公司签署《房屋转让协议》,约定公司以5,873.40万元的对价受让当代科技所有的位于成都市走马街55号友谊广场B座6、18、19层房产,建筑面积共6,174.40平方米。2012年第三季度公司合计支付5,687.16万元,剩余186.24万元对价尚未支付;公司2012年为武汉当代科技集团股份有限公司代付房产税等往来款共计100.20万元。2013年12月,公司与武汉当代科技集团股份有限公司签署《债务抵销协议》,双方拟就公司应付当代科技186.24万元的购房款余额与公司武汉当代科技集团股份有限公司的其他应收款余额进行抵销,本次抵销后,截至2013年末公司对武汉当代科技集



团股份有限公司的其他应收款余额为 373.00 万元，同时公司无需再向武汉当代科技集团股份有限公司支付购房款尾款 186.24 万元。

2015 年 10 月，武汉当代科技集团股份有限公司出具《承诺函》，确认截至 2015 年 6 月 30 日，武汉当代科技集团股份有限公司对公司的应付款项余额为 373.00 万元，并承诺于 2015 年 12 月 31 日前将该笔应付款项全额支付给公司。2015 年 12 月 29 日，武汉当代科技集团股份有限公司向公司全额支付了 373.00 万元的应付款项。

(3) 2015 年 3 月，公司与武汉市阳逻中扬贸易有限公司及武汉国资三方签署《武汉国创资本投资有限公司股权合作框架协议》，协议约定武汉国有资产经营公司（以下简称“武汉国资”）作为武汉国创资本投资有限公司（以下简称“国创资本”）的独资股东同意公司与中扬贸易增资入股国创资本，同时武汉国资与公司签署了《委托经营管理协议》委托公司团队对国创资本进行托管经营。协议约定本次增资后公司与扬中贸易合计持有国创资本的股权不超过 55%，同时公司与中扬贸易任何一方持股比例亦不超过 35%。协议签署后由公司负责对国创资本进行尽职调查，如经过审计、评估及尽职调查后国创资本总资产、净资产与实际数据差异在 3%以内则此次股权合作不可撤销，完成尽职调查后三方签署不可撤销的投资入股协议。此次股权合作完成后，三方各自所持国创资本的股权在三年内不得转让。

2015 年 5 月 7 日，公司与武汉国资签署《备忘录》，同意成立托管委员会履行托管期间董事会职能直至国创资本增资扩股完成并组建新董事会，拟任托管委员会成员即为未来新董事会人员，5 名董事中由公司派出 1 名。同时，公司需在 5 月底前预付增资资金 2 亿元。2015 年 6 月 1 日，天风天盈投资有限公司向国创资本支付了 2 亿元的增资款。同年 10 月，国创资本将 2 亿元增资款全额退还给天风天盈。

2015 年 11 月，天风天盈、武汉市阳逻中扬贸易有限公司与武汉国资三方签署《增资扩股协议》，约定对国创资本进行增资，将国创资本注册资本规模由 13,500 万元增至 30,000 万元。本次国创资本增资扩股信息于 2015 年 9 月 28 日至 2015 年 10 月 29 日在武汉光谷联合产权交易所网站公示，公告期满天风天盈、武汉市阳逻中扬贸易有限公司成为最终投资者。根据湖北衡平资产评估有限责任公司出具并经武汉市人民政府国有资产监督管理委员会备案的《资产评估报告》（鄂衡平评字[2015]第 165 号），国创资本截至 2014 年 12 月 31 日经评估的净资产为 66,105.50 万元，每股净资产约为 4.897 元/出资额。根据前述资产评估结果，本次增资价格约为 4.897 元/出资额，其中天风天盈以 51,415.39 万元对价认缴 10,500 万元出资额，武汉市阳逻中扬贸易有限公司以 29,380.22 万元对价认缴 6,000 万元出资额，增资后



武汉国资、天风天盈、武汉市阳逻中扬贸易有限公司持有国创资本的股权比例分别为 45%、35% 及 20%，天风天盈、武汉市阳逻中扬贸易有限公司应于协议生效日起 10 个工作日内一次性支付投资款项。三方约定此次增资扩股合作完成后各方所持国创资本股权在三年内不得转让，三年后在满足一定约定条件下方可转让。增资扩股后国创资本董事会设五名董事，其中武汉国资推荐两名，天风天盈、武汉市阳逻中扬贸易有限公司合计推荐两名，设立独立董事一名。2015 年 10 月和 12 月，天风天盈合计将 51,415.39 万元的对价全额转入武汉光谷联合产权交易所江城产权交易有限公司的账户。2015 年 12 月国创资本完成本次增资的工商变更。

(4) 2014 年 5 月，公司子公司天风天盈投资有限公司（以下简称“天风天盈”）与武汉光谷科信小额贷款股份有限公司（以下简称“科信小贷”）签署《定向资管管理合同项下收益权（受益权）及资管合同权益转让协议》，根据该协议约定，天风天盈持有公司设立的天源八号定向资产管理计划（第十八期）项下收益权（受益权），天风天盈将此资管合同项下收益权（受益权）及归属于委托方、受益人的全部权利、义务、责任以 1,641.00 万元的对价转让给科信小贷。截至 2014 年 5 月 19 日，科信小贷向天风天盈累计全额支付了 1,641.00 万元对价。天源八号定向资产管理计划（第十八期）对应的投资项目为武汉天捷工程技术有限公司 100% 股权收益权转让及回购，天风天盈初始委托资金金额 1,500.00 万元整，项目收益率为 2% 每月，超过 60 天后则 3% 每月。天风天盈于 2014 年 5 月按照本金与应收利息之和 1,641.00 万元将收益权转让给科信小贷。该项目 2014 年 6 月实际到期后天源八号定向计划向科信小贷支付了 1,704.19 万元的到期本金及收益。

(5) 其他关联方交易情况

年度	关联方名称	期初收益权转让的余额	本年度收益权转让金额	本年度收回收益权金额	期末收益权转让的余额	起始日	到期日	备注
2015 年度	武汉新星汉宜化工有限公司		45,000,000.00		45,000,000.00	2015-5-26		股权收益权
2015 年度	武汉当代科技产业集团股份有限公司		170,000,000.00		170,000,000.00	2015-5-28		股权收益权
2015 年度	武汉当代科技产业集团股份有限公司	100,000,000.00			100,000,000.00	2015-2-16		债权收益权、股权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		9,000,000.00	9,000,000.00		2015-5-5	2015-7-1	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00	10,000,000.00		2015-5-19	2015-12-24	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		5,000,000.00	5,000,000.00		2015-6-30	2015-7-1	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	5,024,930.00		5,024,930.00		2014-11-28	2015-1-26	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	1,000,000.00		1,000,000.00		2014-12-31	2015-12-31	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	64,500,000.00		64,500,000.00		2014-7-17	2015-6-29	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		4,900,000.00		4,900,000.00	2015-4-15	2016-4-14	债权收益权
2015 年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		45,000,000.00	45,000,000.00		2015-2-6	2015-6-30	债权收益权



年度	关联方名称	期初收益权转让的余额	本年度收益权转让金额	本年度收回收益权金额	期末收益权转让的余额	起始日	到期日	备注
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		20,000,000.00	20,000,000.00		2015-1-14	2015-7-13	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		20,000,000.00	20,000,000.00		2015-3-4	2015-12-30	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		56,200,000.00		56,200,000.00	2015-1-26	2015-11-14	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		30,000,000.00	20,000,000.00	10,000,000.00	2015-3-31	2017-3-30	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		6,000,000.00		6,000,000.00	2015-10-30	2017-10-29	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		3,500,000.00		3,500,000.00	2015-11-8	2020-11-8	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		83,000,000.00		83,000,000.00	2015-10-28	2015-11-26	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		17,000,000.00		17,000,000.00	2015-11-18	2016-2-16	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		40,000,000.00		40,000,000.00	2015-11-2	2016-1-1	债权
2015年度	武汉国创资本投资有限公司		80,000,000.00	80,000,000.00		2015-12-1	2015-12-8	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00	10,000,000.00		2015-11-2	2015-11-12	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		19,000,000.00	19,000,000.00		2015-10-13	2015-11-1	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		19,000,000.00	19,000,000.00		2015-12-16	2015-12-16	债权
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		30,000,000.00		30,000,000.00	2015-12-29	2016-1-4	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		100,000,000.00		100,000,000.00	2015-5-4	2016-8-4	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00	2015-9-21	2016-9-30	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00	2015-9-30	2016-9-30	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00		10,000,000.00	2015-9-30	2016-9-30	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		13,000,000.00	13,000,000.00		2015-11-18	2015-12-7	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		5,000,000.00		5,000,000.00	2015-11-16	2016-11-16	债权收益权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		15,000,000.00		15,000,000.00	2015-12-31	2016-12-31	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		1,500,000.00	1,500,000.00		2015-7-28	2015-8-5	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		500,000.00	500,000.00		2015-7-28	2015-8-12	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		18,500,000.00	18,500,000.00		2015-1-16	2015-2-27	债权
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		5,000,000.00		5,000,000.00	2015-4-13	2016-4-13	债权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		5,024,930.00		5,024,930.00	2014-11-28	2015-1-26	债权收益权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		1,000,000.00		1,000,000.00	2014-12-31	2015-12-31	债权收益权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		70,000,000.00	5,500,000.00	64,500,000.00	2014-7-17	2015-6-29	债权收益权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		50,000,000.00	50,000,000.00		2014-11-27	2014-12-30	债权收益权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00	10,000,000.00		2014-12-12	2015-1-10	债权收益权
2014年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		5,000,000.00	5,000,000.00		2014-9-19	2014-9-26	债权收益权
2014年度	武汉当代科技产业集团股份有限公司		100,000,000.00		100,000,000.00	2014-11-11	2015-2-16	债权收益权

年度	关联方名称	期初借款余额	本年度收到借款	本年度偿还借款	期末借款余额	起始日	到期日	备注
2015年度	湖北三环资本管理有限公司		5,000,000.00		5,000,000.00	2015-12-30	2016-1-8	债权收益权转让及回购



年度	关联方名称	期初借款余额	本年度收到借款	本年度偿还借款	期末借款余额	起始日	到期日	备注
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		62,000,000.00	62,000,000.00		2015-9-16	2015-9-16	借款合同
2015年度	武汉国创资本投资有限公司		50,000,000.00	50,000,000.00		2015-10-15	2015-10-16	借款合同
2015年度	武汉国创资本投资有限公司		50,000,000.00	50,000,000.00		2015-10-19	2015-10-20	借款合同
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		12,000,000.00	12,000,000.00		2015-11-30	2015-12-8	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		80,000,000.00	80,000,000.00		2015-8-20	2015-8-21	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		60,000,000.00	60,000,000.00		2015-9-9	2015-9-10	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		60,000,000.00	60,000,000.00		2015-10-30	2015-11-6	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		20,000,000.00	20,000,000.00		2015-11-3	2015-11-12	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		40,000,000.00	40,000,000.00		2015-12-2	2015-12-2	借款合同
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		7,000,000.00		7,000,000.00	2015-10-14	2016-1-11	借款合同
2015年度	武汉国创资本投资有限公司		200,000,000.00	200,000,000.00		2015-12-24	2015-12-25	借款合同
2015年度	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司		10,000,000.00	10,000,000.00		2015-9-14	2015-10-9	借款合同
2015年度	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司		30,000,000.00	30,000,000.00		2015-9-15	2015-12-31	借款合同
2015年度	武汉国创资本投资有限公司		50,000,000.00		50,000,000.00	2015-12-28	2016-3-27	股权收益权转让与回购

(六) 关联方应收应付款项

1、 应收项目

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	武汉道博股份有限公司			5,000,000.00	250,000.00
预付款项	湖北省担保集团有限责任公司	7,500,000.00		7,500,000.00	
预付款项	武汉奥多生物医药有限公司			43,500,000.00	
预付款项	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	2,903,175.00			
其他应收款	武汉国创金融服务有限公司	129,891.65	12,989.17	129,891.65	6,494.58
应收利息	武汉当代科技产业集团股份有限公司			1,062,500.00	
应收利息	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	13,286,423.72			
应收利息	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	19,726.03			
其他应收款	武汉当代科技产业集团股份有限公司			3,730,038.23	664,425.50
其他流动资产	武汉当代科技产业集团股份有限公司			100,000,000.00	
其他流动资产	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	256,100,000.00			
其他流动资产	武汉市江岸区华创小额贷款有限公司	30,000,000.00			



项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
其他非流动资产	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	119,500,000.00			
可供出售金融资产	武汉当代科技产业集团股份有限公司	270,000,000.00			
可供出售金融资产	武汉新星汉宜化工有限公司	101,604,249.11			

2、应付项目

项目名称	关联方	期末余额	期初余额
应付账款	武汉市正隆财富管理有限公司	9,369.86	
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司	2,677,713.57	8,193.02
代理买卖证券款	武汉国有资产经营公司	15.50	2,691.32
代理买卖证券款	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	2,212.61	2,204.80
代理买卖证券款	正隆（北京）保险经纪股份有限公司	169.85	
代理买卖证券款	湖北银丰天睿资产管理有限公司	898,673.64	
其他应付款	武汉国创金融服务有限公司		43,000,000.00
其他流动负债	武汉光谷科信小额贷款股份有限公司	7,000,000.00	
其他流动负债	湖北三环资本管理有限公司	5,000,000.00	
其他流动负债	武汉国创资本投资有限公司	50,000,000.00	

十一、承诺及或有事项

（一）承诺事项

截至报告日止，公司无重大需披露的承诺事项。

（二）或有事项

1、未决诉讼、仲裁

（1）中航证券有限公司诉天风证券股份有限公司逾期支付承销费

2014年10月中航证券有限公司（以下简称“中航证券”）向江西省南昌市中级人民法院（以下简称“南昌中院”）提起诉讼，诉称因2013年与发行人共同承销武汉人福药业集团股份有限公司非公开发行项目的承销协议纠纷，要求天风证券依约支付承销费用共计约人民币599万和赔偿迟延支付承销费义务给中航证券造成的利息损失约人民币41万。

2014年12月17日，南昌中院向发行人下发《应诉通知书》。2014年12月30日，发行人向南昌中院提交《管辖异议申请书》。2015年2月3日，南昌中院作出（2014）洪民二初字第849号《民事裁定书》，驳回发行人对本案管辖权提出的异议。2015年2月25日，发行人



向江西省高级人民法院（以下简称“江西高院”）提出上诉。2015年4月22日，江西高院作出(2015)赣立终字第42号《民事裁定书》，支持发行人的管辖权异议申请，裁定撤销南昌中院（2014）洪民二初字第849号民事裁定，将本案移送至湖北省武汉市中级人民法院审理。

截至报告日，本案尚处于移送武汉市中级人民法院过程中。

（2）天风汇盈壹号（武汉）创业投资中心（有限合伙）诉湖北依思雅服饰有限公司等三人案

天风汇盈壹号（武汉）创业投资中心（有限合伙）（以下简称“汇盈壹号”）于2015年3月向武汉市中级人民法院提起诉讼，诉称湖北依思雅服饰有限公司（以下简称“依思雅”）未按照其与汇盈壹号签订的《收益权转让与回购合同》的约定向汇盈壹号支付合同收益权回购款项，该合同的保证人湖北星宇服装有限责任公司（以下简称“星宇服装”）、质押人富程投资控股集团有限公司（以下简称“富程投资”）未按照合同的约定履行相关保证和担保责任。汇盈壹号请求人民法院判令被告依思雅向汇盈壹号支付回购本金、回购溢价款、逾期付款违约金等款项合计27,430,000元；判令星宇服装对上述依思雅的付款义务承担连带清偿责任；判令依法处分富程投资提供质押担保的质押物，所得款优先用于归还依思雅拖欠款项及费用；判令诉讼费由依思雅等三被告共同承担。2015年11月23日，湖北省武汉市中级人民法院就天风汇盈壹号（武汉）创业投资中心（有限合伙）诉湖北依思雅服饰有限公司等借款合同纠纷案作出了编号为（2015）鄂武汉中民商初字第00470号的《民事判决书》，并以公告送达方式于2016年1月20日刊登在《人民法院报》。

截至报告日，上述判决尚未执行，且未过上诉期，尚无当事人提起上诉。

（3）汇盈壹号诉湖北大明水产科技有限公司等二人案

汇盈壹号于2015年3月向武汉市中级人民法院提起诉讼，诉称湖北大明水产科技有限公司（以下简称“大明水产”）未按照其与汇盈壹号签订的《收益权转让与回购合同》的约定向汇盈壹号支付合同收益权回购款项，该合同的保证人曾程未按照合同的约定履行相关保证责任。汇盈壹号请求人民法院判令被告大明水产向天风天睿支付回购本金、回购溢价款、逾期付款违约金等款项合计9,726,600元；判令曾程对上述大明水产的付款义务承担连带清偿责任；判令诉讼费由大明水产及曾程二被告共同承担。2015年11月24日，湖北省武汉市中级人民法院就汇盈壹号诉大明水产等借款合同纠纷案出具（2015）鄂武汉中民商初字第00471



号《民事判决书》，并以公告送达方式于2016年1月20日刊登在《人民法院报》

截至报告日，上述判决尚未执行，且未过上诉期，尚无当事人提起上诉。

(4) 天风天睿投资有限公司诉大明水产等四人案

天风天睿于2015年3月向武汉市中级人民法院提起诉讼，诉称大明水产未按照其与天风天睿签订的《收益权转让与回购合同》的约定向天风天睿支付合同收益权回购款项，该合同的保证人曾士祥、曾程、质押人富程投资未按照合同的约定履行相关保证和担保责任。天风天睿请求人民法院判令被告大明水产向天风天睿支付回购本金、回购溢价款、逾期付款违约金等款项合计22,555,200元；判令曾士祥、曾程对上述大明水产的付款义务承担连带清偿责任；判令依法处分富程投资提供质押担保的质押物，所得款优先用于归还大明水产欠款项及费用；判令诉讼费由大明水产等四被告共同承担。2015年4月13日，天风天睿向武汉市中级人民法院提出追加被告及变更诉讼请求申请，申请依法追加被申请人兰正新为本案第五被告参加诉讼；相应变更诉讼请求如下：1、请求判令第一被告向原告支付回购本金1,524万元；支付至回购本金清偿日止的回购溢价款人民币3,124,200元（以回购本金为基数，按溢价率1.5%/30每天暂算至2015年3月13日，权利主张至欠款付清之日）；支付至回购价款清偿之日止的逾期付款违约金人民币2,667,000元（以回购本金为基数，按每逾期一日0.1%暂算至2015年3月13日，权利主张至欠款付清之日）；支付因其他违约情形而发生的违约金1,524,000元，以上款项合计22,555,200元；2、判令第二被告对第一被告的上述付款义务承担连带清偿责任；3、判令第三被告对第一被告的上述付款义务承担连带清偿责任；4、判令处分第四被告提供质押担保的质押物（湖北富程魔芋产业发展有限公司合计70%的股权及派生权益），所得款项优先用于归还第一被告拖欠款项及费用；5、判令依法处分第五被告提供质押担保的质押物（湖北富程魔芋产业发展有限公司合计27%的股权及派生权益），所得款项优先用于归还第一被告拖欠款项即费用；6、本案的诉讼费由上述被告共同承担。

截至报告日，武汉市中级人民法院尚未就上述案件作出判决。

2、除上述事项外，截至报告日止，本公司无重大需披露的或有事项。



十二、 资产负债表日后事项

1、2015年12月10日，公司第二届董事会第九次会议审议通过了《关于参与公开摘牌受让华泰保险股权的议案》。公司全资子公司天风天睿投资有限公司（以下简称“天风天睿”）于2015年12月23日在北京产权交易所以人民币1,288,552,357.00元摘牌取得了中国石化财务有限责任公司持有的华泰保险集团股份有限公司4.45%的股权。根据合同规定，公司2015年12月11日支付的193,282,357.00元保证金直接转为产权交易部分价款，天风天睿2016年1月21日支付剩余1,095,270,000.00元股权款，因该股权转让事项尚需经过中国保险监督管理委员会等相关部门审核，本次交易正在推进中。

2、截止报告日，公司无重大需披露的资产负债表日后事项。

十三、 其他重要事项

（一）前期会计差错

1、 追溯重述法

本报告期未发生采用追溯重述法的前期会计差错。

2、 未来适用法

本报告期未发生采用未来适用法的前期会计差错。

（二）分部报告

1、 分部报告的确定依据与会计政策

本公司的报告分部按照经营业务类型的不同，主要划分为：证券及期货经纪业务分部、证券自营业务分部、投资银行业务分部、资产管理业务分部以及其他业务分部。

2、 分部报告的财务信息



(1) 2015年度

项 目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	期货经纪业务	其他业务	直投业务	抵消	合计
一、营业收入	688,281,493.23	1,575,247,454.65	740,752,357.17	189,956,294.58	82,238,118.93	-211,287,732.54	201,176,146.79	-42,525,013.09	3,223,839,119.72
手续费及佣金净收入	541,620,639.12	63,198,180.55	704,449,713.95	189,336,078.36	52,268,437.34	18,531,550.32	41,516,508.09	-34,836,767.99	1,576,084,339.74
投资收益	1,692,325.25	1,244,144,242.42	18,138,598.25	289,836.18	2,684,953.42	13,779,258.41	29,848,200.72	-10,234,056.09	1,300,343,358.56
其他收入	144,968,528.86	267,905,031.68	18,164,044.97	330,380.04	27,284,728.17	-243,598,541.27	129,811,437.98	2,545,810.99	347,411,421.42
二、营业支出	451,799,027.79	503,891,051.27	505,753,137.62	94,454,667.40	73,491,593.23	228,175,032.02	105,320,881.14	-21,117,581.55	1,941,767,808.92
三、营业利润	236,482,465.44	1,071,356,403.38	234,999,219.55	95,501,627.18	8,746,525.70	-439,462,764.56	95,855,265.65	-21,407,431.54	1,282,071,310.80
四、资产总额	8,825,837,403.37	16,288,682,741.91	1,379,819,691.52	155,027,539.07	1,268,997,668.25	15,609,717,866.69	5,855,797,899.72	-10,872,158,238.46	38,511,722,562.07
五、负债总额	5,778,698,349.84	8,493,088,444.67	1,081,588,699.76	38,978,666.03	1,092,555,689.91	8,751,229,021.02	1,221,556,571.88	-919,668,685.30	25,538,026,757.81
六、补充信息									
资产减值损失	14,613,831.50	80,771.82	250,126.71	1,222,719.41	26,306.07	417,564.19	22,661,708.28	-43,960.13	39,229,067.85

(2) 2014年度

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	期货经纪业务	其他业务	直投业务	抵消	合计
一、营业收入	200,754,183.19	383,736,157.89	378,763,244.93	44,755,929.08	94,777,101.80	18,244,734.80	43,064,438.45	-51,926,190.00	1,112,169,600.14
手续费及佣金净收入	160,022,149.47	706,626.11	360,334,975.45	44,760,938.57	75,057,381.35	184,540.93	9,562,444.65	-	650,629,056.53
投资收益	-642,976.38	273,376,303.90	10,143,544.25	-	3,162,943.99	50,000,000.00	5,629,744.88	-51,926,190.00	289,743,370.64
其他收入	41,375,010.10	109,653,227.88	8,284,725.23	-5,009.49	16,556,776.46	-31,939,806.13	27,872,248.92	-	171,797,172.97
二、营业支出	163,057,298.89	72,363,664.63	310,260,310.52	23,737,043.09	91,661,169.79	150,522,086.48	21,587,149.21	-	833,188,722.61
营业利润	37,696,884.30	311,372,493.26	68,502,934.41	21,018,885.99	3,115,932.01	-132,277,351.68	21,477,289.24	-51,926,190.00	278,980,877.53
资产总额	3,619,392,990.52	8,626,267,740.35	345,267,704.17	12,705,654.69	953,109,001.71	3,933,034,043.73	1,682,416,654.60	-3,119,245,493.03	16,052,948,296.74
负债总额	3,041,574,282.95	6,863,530,887.91	270,102,220.52	12,436,734.16	817,146,089.59	1,645,283,869.94	574,004,660.91	-919,058,648.17	12,305,020,097.81
六、补充信息									
资产减值损失	-52,038.82	29,793.23	611,720.12	163,831.81	50,507.65	4,097,056.72	2,395,618.37	-	7,296,489.08



(三) 社会责任支出

名称	本期发生额	上期发生额
救灾捐款	-	-
教育捐助	760,000.00	396,821.00
慈善捐助	224,000.00	295,000.00
其他	300,000.00	60,000.00
合计	1,284,000.00	751,821.00

十四、 母公司重要财务报表项目注释

(一) 长期股权投资

项目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	1,351,565,476.16		1,351,565,476.16	503,165,476.16		503,165,476.16
对联营、合营企业投资	540,747,788.41		540,747,788.41			
合计	1,892,313,264.57		1,892,313,264.57	503,165,476.16		503,165,476.16

1、对子公司投资

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备期末余额
天风天睿投资有限公司	271,965,476.16	610,000,000.00		881,965,476.16		
天风期货股份有限公司	181,200,000.00	32,400,000.00		213,600,000.00		
天风天盈投资有限公司	50,000,000.00	200,000,000.00		250,000,000.00		
天风创新投资股份有限公司		6,000,000.00		6,000,000.00		
合计	503,165,476.16	848,400,000.00		1,351,565,476.16		

2、对联营、合营企业投资

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		
联营企业											
宜宾市商业银行股份有限公司	541,551,919.00			13,753,326.17	2,930,893.24		17,488,350.00			540,747,788.41	
合计	541,551,919.00			13,753,326.17	2,930,893.24		17,488,350.00			540,747,788.41	



(二) 手续费及佣金净收入

项 目	本期发生额	上期发生额
手续费及佣金收入：		
1.经纪业务收入	525,244,761.15	162,097,725.89
其中：证券经纪业务	525,244,761.15	162,097,725.89
其中：代理买卖证券业务	468,850,769.76	157,414,064.42
交易单元席位租赁	31,227,994.01	3,599,212.04
代销金融产品业务	25,165,997.38	1,084,449.43
期货经纪业务		
2.投资银行业务收入	599,931,519.63	171,686,283.33
其中：证券承销业务	457,907,666.00	93,579,500.00
保荐服务业务	10,710,989.00	1,200,000.00
财务顾问业务	131,312,864.63	76,906,783.33
3.投资咨询服务收入	47,033,467.56	38,508,965.95
4.资产管理业务收入	110,955,213.09	44,760,938.57
5.其他	839,088.77	
手续费及佣金收入小计	1,284,004,050.20	417,053,913.74
手续费及佣金支出：		
1.经纪业务支出	5,487,713.89	320,596.95
其中：证券经纪业务支出	5,487,713.89	320,596.95
其中：代理买卖证券业务	5,487,713.89	320,596.95
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
期货经纪业务支出		
2.投资银行业务支出		
其中：证券承销业务		
保荐业务服务		
财务顾问业务支出		
3.投资咨询业务		
4.资产管理业务		
5.其他		
手续费及佣金支出小计	5,487,713.89	320,596.95
手续费及佣金净收入	1,278,516,336.31	416,733,316.79



(三) 利息净收入

项 目	本期发生额	上期发生额
利息收入		
1.拆出资金利息收入		
2.买入返售金融资产利息收入	546,314,600.18	203,950,845.79
3.存放金融同业利息收入	96,580,465.63	24,749,525.64
4.融资融券利息收入	169,940,621.15	38,948,571.51
5.其他利息收入	155,188.46	1,395,833.33
利息收入小计	812,990,875.42	269,044,776.27
利息支出		
1.客户资金存款利息支出	15,787,609.90	3,355,754.84
2.卖出回购金融资产利息支出	539,680,334.59	181,401,503.67
3.拆入资金利息支出	36,189,490.48	11,380,361.09
其中：转融通利息支出	34,000,668.80	9,713,472.21
4.债券、短期融资券及收益凭证利息支出	270,168,698.37	43,789,572.60
5.其他利息支出	221,109.68	
利息支出小计	862,047,243.02	239,927,192.20
利息净收入	-49,056,367.60	29,117,584.07

(四) 投资收益

项 目	本期发生额	上期发生额
1.权益法确认的收益	13,753,326.17	
2.成本法确认的收益		50,000,000.00
3.金融工具持有期间取得的分红和利息	435,727,639.41	151,592,539.49
其中：交易性金融资产	347,343,633.05	147,073,361.11
持有至到期投资	2,565,410.99	517,315.68
可供出售金融资产	85,818,595.37	4,001,862.70
4.处置收益	758,223,572.31	121,140,788.03
其中：交易性金融资产	785,283,603.25	108,703,590.09
持有至到期投资		251,702.59
可供出售金融资产	56,427,783.79	-1,480,783.47
衍生金融工具	-83,487,814.73	13,666,278.82
合 计	1,207,704,537.89	322,733,327.52



(五) 公允价值变动收益

产生来源	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产公允价值变动损益	213,037,892.98	83,177,614.17
交易性金融负债公允价值变动损益	1,312,886.02	-1,312,886.02
衍生金融工具公允价值变动损益	-1,956,759.52	2,522,425.42
合 计	212,394,019.48	84,387,153.57

十五、 补充资料

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	
	本年度	上年度	本年度	上年度	本年度	上年度
归属于公司普通股股东的净利润	13.54	8.98	0.239	0.104	0.239	0.104
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	13.60	8.90	0.240	0.103	0.240	0.103



第 1 页至第 87 页的财务报表附注由下列负责人签署：

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：

签名： _____

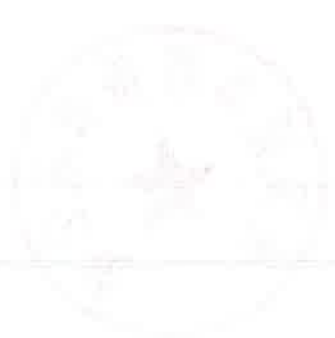
签名： _____

签名： _____

日期： _____

日期： _____

日期： _____





营业执照

(副本)(6-1)

统一社会信用代码 91110108590611484C

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日 至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



在线扫码获取详细信息

登记机关



2016年01月05日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。



证书序号: NO. 019736

说明

1. 《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批, 准予执行注册会计师法定业务的凭证。
2. 《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的, 应当向财政部门申请换发。
3. 《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
4. 会计师事务所终止, 应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



中华人民共和国财政部制

会计师事务所 执业证书

名称: 大信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 胡咏华

办公场所: 北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

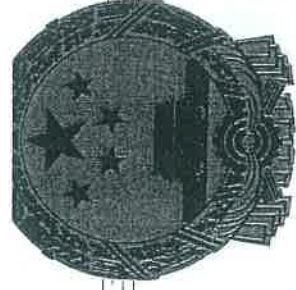
组织形式: 特殊普通合伙

会计师事务所编号: 11010141

注册资本(出资额): 3130万元

批准设立文号: 京财会许可[2011]0073号

批准设立日期: 2011-09-09



证书序号: 000418

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

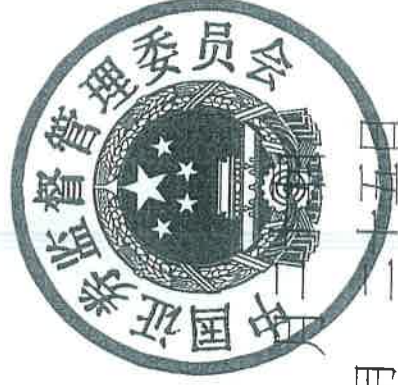
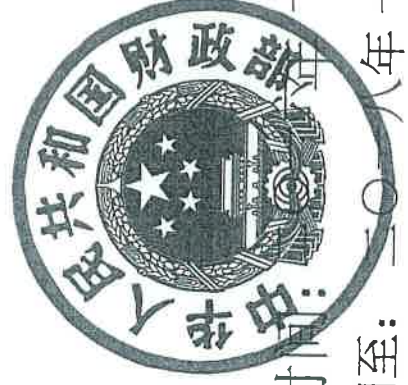
经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准
大信会计师事务所(特殊普通合伙) 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人: 胡咏华

证书号: 08

发证时间:

证书有效期至:



二〇〇八年一月二十五日





姓名 向辉
 Full name 向辉
 性别 男
 Sex 男
 出生日期 1978-06-07
 Date of birth 1978-06-07
 工作单位 大信会计师事务所有限公司湖北分公司
 Working unit 大信会计师事务所有限公司湖北分公司
 身份证号码 420106197806072411
 Identity card No. 420106197806072411



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after this renewal.



证书编号:
 No. of Certificate 42000320472

批准注册协会:
 Authorized Institute of CPA, 湖北省注册会

发证日期: 2007
 Date of Issuance

年 月 日



年 月 日





中国注册会计师协会

姓名	郭晗
Full name	郭晗
性别	女
Sex	女
出生日期	1982-09-26
Date of birth	1982-09-26
工作单位	大信会计师事务所湖北分所
Working unit	大信会计师事务所湖北分所
身份证号码	421022198209263420
Identity card No.	421022198209263420



年度检验登记

Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.



证书编号:
No. of Certificate

110100690058

批准注册协会:
Authorized Institute of CPAs

湖北省注册会计师协会

发证日期:
Date of Issuance

2010 年 6 月 13 日





天风证券股份有限公司

净资产审核报告

大信专审字[2016]第 2-00097 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.







大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

净 资 本 审 核 报 告

大信专审字[2016]第 2-00097 号

天风证券股份有限公司：

我们审计了后附的天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）2015年12月31日的净资本计算表、风险控制指标监管报表及风险资本准备计算表（以下统称“净资本监管报表”），净资本监管报表已由贵公司管理层依照中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）颁布的《证券公司风险控制指标管理办法》（中国证监会第55号令）、《关于调整证券公司净资本计算标准的规定》（中国证监会公告[2012]37号）、《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》（中国证监会公告[2008]28号）、《关于修改〈关于证券公司风险资本准备计算标准的规定〉的决定》（中国证监会公告[2012]7号）、《关于修改〈关于证券公司风险资本准备计算标准的规定〉的决定》（中国证监会公告[2012]36号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第1号——股指期货、融资融券》（沪证监机构字[2010]347号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第1号——股指期货、融资融券》（深证局机构字2010161号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第2号——证券自营业务》（中国证监会机构部部函[2011]189号）（以下统称“净资本监管报表编制基础”）编制。

一、管理层的责任

编制和公允列报净资本监管报表是贵公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照净资本监管报表编制基础编制净资本监管报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使净资本监管报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对净资本监管报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对净资本监管报表是否不存在重大错报获取



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxin CPA.com.cn

合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关净资产监管报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的净资产监管报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与净资产监管报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价净资产监管报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审核意见

我们认为，贵公司净资产监管报表在所有重大方面按照净资产监管报表编制基础编制。

四、报告使用范围说明

本报告仅限于贵公司向中国证监会及其派出机构报送净资产监管报表之用，不得用于其它目的。因使用不当造成的后果，与执行本审计业务的注册会计师及会计师事务所无关。

附件一：证券公司净资产计算表

附件二：证券公司风险控制指标监管报表

附件三：证券公司风险资本准备计算表

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一六年二月二十四日

证券公司净资本计算表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初余额	期末余额	扣减比例	应计算金额	
					期初金额	期末金额
净资产	1	3,000,911,392.02	9,049,823,210.07		3,000,911,392.02	9,049,823,210.07
减：金融资产的风险调整合计	2	3,713,180,728.75	12,047,635,763.35		356,830,042.00	822,628,382.92
1. 股票注1	3	518,512,498.59	863,046,357.46		38,587,668.74	81,910,786.43
其中：上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	4	340,039,166.26	246,594,593.59	5%	17,001,958.31	12,329,729.68
一般上市股票	5	165,281,138.13	135,092,960.21	10%	16,528,113.81	13,509,296.02
流通受限的股票	6	12,092,890.00	280,358,803.66	20%	2,418,576.00	56,071,760.73
持有一种股票的价值与该股票市值的比例超过10%的	7			40%		
ST股票	8	190,679.00		50%	95,339.50	
*ST股票	9	905,635.20		60%	543,381.12	
已退市且在代办股份转让系统挂牌的股票	10			80%		
已退市且未在代办股份转让系统挂牌的股票	11			100%		
2. 货币市场基金	12	187,599,140.57	19,041,891.39	0%		
3. 证券投资基金注2	13	41,716,041.93	292,510,690.31	1%	417,160.42	2,925,106.90
4. 固定收益类证券注3	14	2,199,080,627.10	6,217,764,947.00		85,815,829.58	252,722,100.18
其中：国债、中央银行票据	15			0%		
金融债券、地方政府债	16	16,913,560.00	169,131,500.00	1%	169,135.50	1,691,315.00
信用评级AAA级的信用债券	17	81,998,950.00	264,464,195.00	2%	1,639,979.00	5,289,283.90
信用评级AAA级以下，BBB级（含）以上的信用债券	18	2,100,168,127.10	5,094,327,182.00	4%	84,006,725.08	227,773,087.28
信用评级BBB级以下的信用债券	19		89,842,070.00	20%		17,968,414.00
5. 可转换债券	20	9,185,317.60		5%	459,265.88	
6. 信托产品投资注4	21	200,000,000.00		80%	160,000,000.00	
7. 集合理财计划投资	22	304,401,990.80	2,254,245,502.27		41,913,840.56	190,436,724.62
其中：投资其他证券公司集合理财计划	23	37,294,000.00	1,466,890,711.89	5%	1,864,700.00	73,344,537.09
投资本公司集合理财计划（未约定先行承担亏损）	24	341,161.17	20,220,530.43	10%	34,116.12	2,022,053.04
投资本公司集合理财计划（约定先行承担亏损）	25	266,766,829.63	767,134,229.95	1.5%	40,015,024.44	115,070,134.49
8. 委托其他证券公司、基金公司的定向、专户等理财投资注5	26	118,330,000.00	151,046,000.00	10%	14,833,000.00	15,104,600.00
9. 其他金融产品投资注6	27	105,355,112.16	2,450,980,574.82	1.5%	15,803,266.82	279,529,064.79
减：衍生金融资产的风险调整合计	28	4,049,710.31	1,995,954.13		4,049,710.31	714,650.13
1. 权证投资	29			20%		
2. 利率互换公允价值变动收益形成的资产	30	4,049,710.31	394,324.13	100%	4,049,710.31	394,324.13
3. 其他衍生金融资产注7	31		1,601,630.00	20%		320,326.00
减：其他资产项目的风险调整合计	32	8,556,444,040.06	13,604,594,559.43		1,254,088,756.23	2,673,640,923.02
1. 拆出资金（合同期以内）	33			0%		
2. 融出资金	34	1,348,829,290.40	1,820,399,012.30	2%	26,976,585.81	32,407,980.25
3. 融出证券注8	35	2,548,582.00		5%	127,429.10	
4. 约定购回融出资金注9	36			5%		
5. 股票质押融出资金注9	37	223,243,811.87	3,227,442,263.15	10%	22,324,381.19	322,744,226.32
6. 买入返售金融资产（未逾期）	38	5,159,057,273.11	5,386,090,658.92	0%		
7. 应收利息	39	22,904,416.08	114,494,750.61	0%		
8. 存出保证金	40	76,484,130.73	280,438,309.63		6,095,246.70	18,405,252.50
其中：交易保证金	41	70,388,884.03	267,033,057.13	0%		
履约保证金	42			10%		
期货保证金注9	43	6,095,246.70	18,275,178.50	100%	6,095,246.70	18,275,178.50
其他存出保证金	44		130,074.00	100%		130,074.00
9. 长期股权投资（不含对上市公司的股权投资）	45	507,665,476.16	1,958,313,264.57		507,665,476.16	1,958,313,264.57
其中：对控股证券业务子公司股权投资	46			100%		
对控股基金、期货等其他金融业务子公司股权投资注11	47	181,200,000.00	213,600,000.00	100%	181,200,000.00	213,600,000.00
对其他业务子公司股权投资注10	48	321,965,476.16	1,137,965,476.16	100%	321,965,476.16	1,137,965,476.16
对境外子公司股权投资	49			100%		
策略性股权投资注11	50		540,747,788.41	100%		540,747,788.41
其他股权投资注12	51	4,500,000.00	66,000,000.00	100%	4,500,000.00	66,000,000.00
10. 投资性房地产	52	98,310,694.34	20,130,091.72	100%	98,310,694.34	20,130,091.72
11. 固定资产	53	92,235,750.72	87,520,736.92		92,235,750.72	87,520,736.92
其中：所有权权属明确的房产	54	67,085,748.72	54,780,702.48	100%	67,085,748.72	54,780,702.48
其他固定资产	55	25,150,002.00	32,740,034.44	100%	25,150,002.00	32,740,034.44
12. 无形资产	56	53,446,529.63	66,026,215.68		52,471,529.63	65,051,215.68
其中：交易席位费	57	1,950,000.00	1,950,000.00	50%	975,000.00	975,000.00
其他无形资产	58	51,496,529.63	64,076,215.68	100%	51,496,529.63	64,076,215.68
13. 商誉	59			100%		
14. 递延所得税资产	60	3,643,336.31	6,215,404.94	100%	3,643,336.31	6,215,404.94
15. 应收股利	61	63,225,000.00	63,248,295.65	0%		
16. 应收融资租赁款	62			100%		
17. 应收款项	63	519,470,733.30	689,005,320.03		58,859,310.86	77,582,514.81
其中：账龄一年以内（含一年）	64	508,625,013.77	674,765,254.73	10%	50,862,501.38	67,476,525.47
账龄一年至二年（含二年）	65	5,697,820.10	8,268,151.92	50%	2,848,910.05	4,134,075.96
账龄二年以上	66	5,147,899.43	5,971,913.38	100%	5,147,899.43	5,971,913.38
应收股东及其关联公司款项	67			100%		
18. 代理承销证券	68			0%		
19. 代兑付债券	69			0%		
20. 待转承销费用	70			100%		
21. 抵债资产	71			100%		
22. 长期待摊费用	72	37,135,280.41	35,161,810.14	100%	37,135,280.41	35,161,810.14
23. 其他注13	73	348,243,735.00	50,108,425.17	100%	348,243,735.00	50,108,425.17
减：或有负债的风险调整合计	74					
1. 对外担保金额（公司为自身负债提供的反担保除外）	75		55,000,000.00	100%		55,000,000.00
2. 对控股证券业务子公司提供的担保承诺	76			100%		
3. 其他或有负债注14	77			100%		
减：中国证监会认定的其他调整项目合计注15	78					
1. 所有权受限等无法变现的资产（如被冻结）	79			100%		
2. 其他项目	80		55,000,000.00	100%		55,000,000.00
加：中国证监会核准的其他调整项目注15	81	750,000,000.00	2,750,000,000.00		825,000,000.00	2,375,000,000.00
1. 借入的次级债务注16	82	750,000,000.00	2,750,000,000.00	70%	825,000,000.00	2,375,000,000.00
2. 母公司提供的担保承诺	83					
净资产金额	86				1,911,942,883.48	7,872,839,254.90

附1：期末或有事项

附2：其他需要特别说明的事项

法定代表人：

财务负责人：

合规总监：



证券公司风险控制指标监管报表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准
净资本	1	1,911,942,883.48	7,872,839,254.00		
净资产	2	3,000,911,392.02	9,049,823,210.07		
净资本/各项风险资本准备之和	3	343.12%	411.91%	>120%	>100%
净资本/净资产	4	63.71%	86.99%	>48%	>40%
净资本/负债	5	19.62%	39.87%	>9.6%	>8%
净资产/负债	6	30.79%	45.83%	>24%	>20%
自营权益类证券及证券衍生品注1/净资本	7	73.28%	74.78%	<80%	<100%
自营固定收益类证券/净资本	8	125.31%	82.86%	<400%	<500%
持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名	9				
其中：天士力	10	4.35%	1.37%	<24%	<30%
天保重装	11		1.27%	<24%	<30%
金达莱	12	0.61%	1.21%	<24%	<30%
东阿阿胶	13	2.42%	1.16%	<24%	<30%
汉商集团	14	1.65%	0.41%	<24%	<30%
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名	15				
其中：天保重装	16		3.66%	<4%	<5%
东方数码	17		1.67%	<4%	<5%
汉商集团	18	1.15%	1.15%	<4%	<5%
雷讯网络	19		1.13%	<4%	<5%
水治理	20		0.54%	<4%	<5%
自有资金参与本公司单个集合计划的份额与总份额的比例前五名	21				
其中：点金1期集合资产管理计划	22	19.23%	20.00%	<16%	<20%
天风同安天时2号集合资产管理计划	23		20.00%	<16%	<20%
天星1号集合资产管理计划	24		19.99%	<16%	<20%
天泽5号集合资产管理计划	25	15.07%	19.95%	<16%	<20%
天泽3号集合资产管理计划	26	19.06%	19.33%	<16%	<20%
对单一客户融资规模与净资本的比例前五名	27				
其中：俞镇权	28	1.31%	0.84%	<4%	<5%
涂双兵	29	3.66%	0.61%	<4%	<5%
陈习志	30	0.35%	0.48%	<4%	<5%
王超	31		0.39%	<4%	<5%
湖北泉源电力	32		0.38%	<4%	<5%
对单一客户融券规模与净资本的比例前五名	33			<4%	<5%
	34			<4%	<5%
	35			<4%	<5%
	36			<4%	<5%
	37			<4%	<5%
	38			<4%	<5%
接受单一担保股票的市值与该股票总市值比例前五名的股票	39				
其中：	40				
	41				
	42				
	43				
	44				

法定代表人：

财务负责人：

合规总监：





证券公司风险资本准备计算表

编制单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

公司分类级别	项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准				风险资本准备		
					连续3年	A	B	C	D	期初余额	期末余额
1、经纪业务风险资本准备		1								14,559,833.12	26,198,408.55
其中：托管的客户交易结算资金		2	1,819,179,140.28	3,274,801,069.25	0.4%	0.6%	0.8%	2%	4%	14,559,833.12	26,198,408.55
2、自营业务风险资本准备注1		3								162,056,861.27	563,395,054.06
其中：(1) 证券衍生品投资规模		4	82,172,001.00	219,090,267.72						6,573,760.08	17,527,221.42
权证		5			4%	6%	8%	20%	40%		
买入股指期货注2		6	1,772,001.00	2,547,882.00	4%	6%	8%	20%	40%	141,760.08	203,830.56
卖出股指期货注2		7		3,618,786.00	4%	6%	8%	20%	40%		289,502.88
买入国债期货注2				4,984,650.00	4%	6%	8%	20%	40%		398,772.00
卖出国债期货注2				3,301,815.00	4%	6%	8%	20%	40%		264,145.20
利率互换注2		8	80,400,000.00	203,100,000.00	4%	6%	8%	20%	40%	6,432,000.00	16,248,000.00
其他				1,537,134.72	4%	6%	8%	20%	40%		122,970.78
(2) 权益类证券投资规模		9	1,311,227,639.48	5,665,657,287.62						78,673,658.38	339,939,437.27
股票		10	511,424,494.59	1,207,544,961.61	3%	4.5%	6%	15%	30%	30,685,469.68	72,452,697.70
股票基金		11	37,699,536.45	114,323.44	3%	4.5%	6%	15%	30%	2,261,972.19	6,859.41
混合基金		12	4,016,505.48	129,728,571.63	3%	4.5%	6%	15%	30%	240,990.33	7,783,714.30
集合理财产品		13	304,401,990.80	2,254,245,502.27	3%	4.5%	6%	15%	30%	18,264,119.45	135,254,730.14
信托产品		14	200,000,000.00		3%	4.5%	6%	15%	30%	12,000,000.00	
其他		15	253,685,112.16	2,074,023,928.67	3%	4.5%	6%	15%	30%	15,221,106.73	124,441,435.72
(3) 固定收益类证券投资规模		16	2,395,865,085.27	6,433,863,578.95						76,667,682.73	205,883,634.53
政府债券		17	16,913,550.00		1.6%	2.4%	3.2%	8%	16%	541,233.60	
公司债券		18	2,182,167,077.10	5,958,791,377.00	1.6%	2.4%	3.2%	8%	16%	69,829,346.47	190,681,324.06
债券基金		19		231,462,814.56	1.6%	2.4%	3.2%	8%	16%		7,406,810.07
其他		20	196,784,458.17	243,609,387.39	1.6%	2.4%	3.2%	8%	16%	6,297,102.66	7,795,500.40
(4) 已对冲风险的自营证券投资		21	7,088,004.00	2,238,042.00						141,760.08	44,760.84
权益类证券		22			1%	1.5%	2%	5%	10%		
卖出股指期货注2		23	7,088,004.00	2,238,042.00	1%	1.5%	2%	5%	10%	141,760.08	44,760.84
债券及其衍生品投资规模注3		24	628,589.00							12,571.78	
固定收益类证券		25			1%	1.5%	2%	5%	10%		
利率互换注2		26			1%	1.5%	2%	5%	10%		
卖出国债期货注2		27	628,589.00		1%	1.5%	2%	5%	10%	12,571.78	
3、承销业务风险资本准备		28								7,040,000.00	38,720,000.00
其中：再融资项目股票承销业务规模		29			6%	9%	12%	30%	60%		
IPO项目股票承销业务规模		30			3%	4.5%	6%	15%	30%		
公司债券承销业务规模注4		31	220,000,000.00	1,210,000,000.00	1.6%	2.4%	3.2%	8%	16%	7,040,000.00	38,720,000.00
政府债券承销业务规模注5		32			0.8%	1.2%	1.6%	4%	8%		
4、资产管理业务风险资本准备		33								110,268,767.18	252,736,544.46
其中：专项理财业务规模		34			0.4%	0.6%	0.8%	2%	4%		
集合理财业务规模		35	663,603,170.93	1,395,031,445.57	0.4%	0.6%	0.8%	2%	4%	5,308,825.37	11,160,251.56
限额特定理财业务规模		36	2,493,016,148.53	24,337,065,482.43	0.2%	0.3%	0.4%	1%	2%	9,972,184.59	97,348,261.93
定向理财业务规模		37	23,746,939,304.66	36,057,007,741.28	0.2%	0.3%	0.4%	1%	2%	94,987,757.22	144,228,030.97
5、融资融券业务风险资本准备		38								27,078,529.09	32,505,496.74
其中：融资业务规模		39	1,348,829,290.40	1,625,274,836.82	1%	1.5%	2%	5%	10%	26,976,585.81	32,505,496.74
融券业务规模注6		40	2,548,582.00		2%	3%	4%	10%	20%	101,943.28	
6、分支机构风险资本准备		41								181,000,000.00	222,000,000.00
其中：分公司家数注7		42	5	6	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2	100,000,000.00	120,000,000.00
营业部家数注7		43	27	34	0.03	0.03	0.03	0.03	0.03	81,000,000.00	102,000,000.00
7、营运风险资本准备		44								36,435,213.63	55,520,582.13
其中：上一年度营业费用注8		45	364,352,136.34	555,205,821.33	10%	10%	10%	10%	10%	36,435,213.63	55,520,582.13
8、其他风险资本准备		46	313,121,736.87	29,356,754,213.14						18,787,304.21	720,204,916.04
其中：中小企业私募债券注9		47	89,877,925.00	89,842,070.00	3%	4.5%	6%	15%	30%	5,392,675.50	5,390,524.20
约定购回式证券交易注10		48			2%	3%	4%	10%	20%		
股票质押式回购交易注10		49	223,243,811.87	3,237,153,724.32	3%	4.50%	6%	15%	30%	13,394,628.71	194,229,223.46
各项风险资本准备之和		50								557,226,508.50	1,911,281,001.98

附：其他需要特别说明的事项

注：1、证券衍生品包括：权证、股指期货、利率互换；权益类证券具体包括：股票、股票基金、混合基金、集合理财产品、信托产品及证券公司委托基金公司、其他证券公司进行的证券投资；固定收益类证券具体包括：债券、债券基金、央行票据、货币市场基金、资产证券化产品。

2、股指期货、利率互换投资规模分别按照股指期货合约价值总额的15%、利率互换合约名义本金总额的3%计算。

3、股指期货、利率互换套期保值满足《企业会计准则第24号—套期保值》有关套期保值高度有效要求的，可认为已对冲风险。

4、公司债券是指以公司为发行人的公司债、企业债、可转债、短期融资券、中期票据等。

5、政府债券是指以政府为发行人的债券。

6、融券业务规模按照融出时证券的市值计算。

7、每家分公司、营业部按0.2亿元、0.03亿元计算风险资本准备，风险资本准备期初期末余额应以元为单位填报。

8、营业费用指业务及管理费、资产减值损失、其他业务成本之和。

9、证券公司承销、自营业务与中小企业私募债券的，应分别按照15%的比例计算承销业务、自营业务风险资本准备（15%为基准比例，不同类别公司按规定实施不同的计算比例）。

法定代表人：

财务负责人：

合规总监：







营业执照

(副本) (6-3)

注册号110108014689085

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日 至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



在线扫码获取详细信息

登记机关



2015 年 08 月 10 日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。





证书序号: NO.006855

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批, 准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的, 应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止, 应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。

会计师事务所 执业证书

名称: 大信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 吴卫星

办公场所: 北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

组织形式: 特殊普通合伙

会计师事务所编号: 11010141

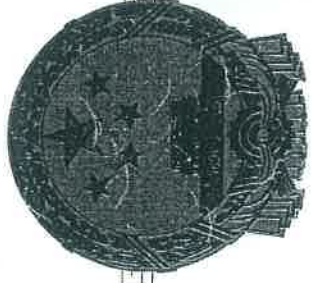
注册资本(出资额): 2920万元

批准设立文号: 京财会许可[2011]0073号

批准设立日期: 2011-09-09



中华人民共和国财政部制



证书序号: 000162

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

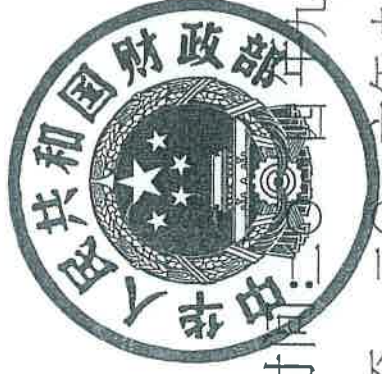
经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准
大信会计师事务所(特殊普通合伙) 执行证券、期货相关业务。

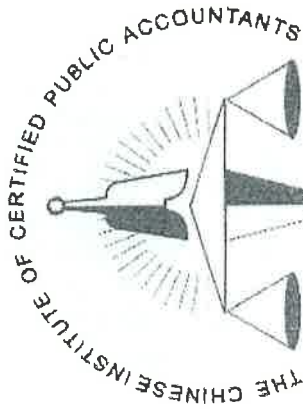
首席合伙人: 吴卫星

证书号: 52

发证时间:

证书有效期至: 二〇二六年九月





姓名 向辉
 Full name
 性别 男
 Sex
 出生日期 1978-06-07
 Date of birth
 工作单位
 Working unit
 身份证号码 420106197806072411
 Identity card No.

大信会计师事务所有限公司
 大信会计师事务所湖北分所



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after
 this renewal.



证书编号：
 No. of Certificate 42000320472

批准注册协会：
 Authorized Institute of CPA 湖北省注册会

发证日期：2007
 Date of Issuance

年 月 日





姓名	郭略
Full name	郭略
性别	女
Sex	女
出生日期	1982-09-26
Date of birth	1982-09-26
工作单位	大信会计师事务所湖北分所
Working unit	大信会计师事务所湖北分所
身份证号码	421022198209263420
Identity card No.	421022198209263420



年度检验登记
Annual Renewal Registration

此证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.



证书编号: 110100690058
No. of Certificate

批准注册协会: 湖北省注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2010 年 6 月 13 日
Date of Issuance





天风证券股份有限公司 内部控制鉴证报告

大信专审字[2016]第 2-00093 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.







大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

内部控制鉴证报告

大信专审字[2016]第 2-00093 号

天风证券股份有限公司全体股东：

我们接受委托，对天风证券股份有限公司(以下简称“贵公司”)2015年12月31日与财务报告相关的内部控制有效性的认定进行了鉴证。

一、管理层对内部控制的责任

按照国家有关法律法规的规定，设计、实施和维护有效的内部控制，并评价其有效性是贵公司管理层的责任。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施鉴证工作的基础上对内部控制有效性发表鉴证意见。我们按照《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。该准则要求我们计划和实施鉴证工作，以对鉴证对象信息是否不存在重大错报获取合理保证。在鉴证过程中，我们实施了包括了解、测试和评价内部控制设计的合理性和执行的有效性，以及我们认为必要的其他程序。

我们相信，我们的鉴证工作为发表意见提供了合理的基础。

三、内部控制的固有局限性

内部控制具有固有限制，存在由于错误或舞弊而导致错报发生而未被发现的可能性。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或降低对控制政策、程序遵循的程度，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

四、鉴证意见

我们认为，贵公司按照《企业内部控制基本规范》和相关规定于2015年12月31日在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

五、其他说明事项

本鉴证报告仅供贵公司申请首次公开发行股票并上市申报之用，不得用于其他目的。由于使用不当所造成的后果，与执行本业务的注册会计师和会计师事务所无关。我们同意将本鉴证报告作为贵公司申请首次公开发行股票所必备的文件，随其他申报材料一起上报。

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一六年二月二十四日

天风证券股份有限公司 2015年度内部控制评价报告

天风证券股份有限公司全体股东：

根据《企业内部控制基本规范》及其配套指引的规定和其他内部控制监管要求（以下简称企业内部控制规范体系），结合天风证券股份有限公司（以下简称公司）内部控制制度和评价办法，在内部控制日常监督和专项监督的基础上，我们对公司2015年12月31日（内部控制评价报告基准日）的内部控制有效性进行了评价。

一、重要声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督，经理层负责组织领导企业内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目标是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进实现发展战略。由于内部控制存在的固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或对控制政策和程序遵循的程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。

二、内部控制评价结论

根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司不存在财务报告内部控制重大缺陷。董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

根据公司非财务报告内部控制重大缺陷认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷。

自内部控制评价报告基准日至内部控制评价报告发出日之间未发生影响内部控制有效性评价结论的因素。



三、 内部控制评价工作情况

(一) 内部控制评价范围

公司按照风险导向原则确定纳入评价范围的主要单位、业务和事项以及高风险领域。内部控制评价的范围贯彻全面性和重要性原则，包括内部控制的设计和运行，重点关注证券经纪、投资银行、证券自营、证券资产管理、证券投资咨询、资金管理、财务管理以及财务报告编制管理等高风险领域，围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等要素对内部控制进行全面评价。

纳入评价范围的主要单位包括：公司以及两家全资子公司一天风天盈投资有限公司（以下简称天风天盈）、天风天睿投资有限公司（以下简称天风天睿）和公司控股的天风期货股份有限公司（以下简称天风期货，公司持股比例为98.63%）。纳入评价范围单位资产总额占公司合并财务报表资产总额的97.48%，营业收入合计占公司合并财务报表营业收入总额的95.43%。评价范围不存在重大遗漏。

纳入评价范围的主要业务和事项包括：

1. 内部环境

(1) 治理结构

公司根据《中华人民共和国公司法》（以下简称《公司法》）、《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）、《证券公司治理准则》等法律、行政法规和规范性文件的规定，建立了由股东大会、董事会、监事会和经理层组成的健全的组织机构和公司治理结构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和经理层之间权责明确、运作规范、互相分离与相互制衡的机制。《公司章程》明确了股东大会、董事会、监事会和经理层的职责权限、议事规则和工作程序等，确保了权力机构、决策机构、执行机构和监督机构之间权责明确、规范运作和有效制衡。

(2) 发展战略

为了促进公司增强核心竞争力和可持续发展能力，公司在董事会下设立发展战略委员会，负责拟定公司的中长期战略目标和发展规划，审议公司各业务及管理条线的中长期战略目标和规划，督导公司战略的执行。公司综合考虑宏观经济政策、国内外市场需求变化、行业发展趋势、竞争对手状况、可利用资源水平和自身优劣势等影响因素制定并实施了公司的发展战略。

公司整体战略：坚定不移走综合证券金融服务的道路，打造以财富管理能力和大投行服务能力为驱动力、以客户为核心、以人才为根本、以快速发展为依托、以一体化综合金融战



略为格局的国际化证券金融机构。

围绕公司整体战略目标，公司全面推进了包括人才平台搭建战略、高速发展战略、“跨区域、跨平台、跨板块”的跨界综合证券金融服务战略等子战略，在合规、风险可控的前提下，保障、支撑公司整体战略目标的实现。

(3) 人力资源

公司重视人力资源体系建设。根据发展战略，结合人力资源现状和未来需求预测，明确人力资源发展目标，建立健全了科学的人才引进、使用、培养、考核、激励、内部调配及退出等制度，整体布局公司的人力资源配置，不断提升人均效能，提高公司核心竞争力。2015 年公司持续完善绩效管理体系，通过设置更科学的业绩考核体系，对各级管理人员和员工进行全面考核与评价，实现员工的优胜劣汰，进一步完善了人力资源的激励约束机制。2015 年公司持续重视员工素质和能力的提升，制定了系统的培训计划，通过多种方式对员工进行不同层级和内容专业培训，健全了员工持续教育机制，促进了全体员工知识技能的持续更新与升级。

(4) 社会责任

公司重视履行社会责任，切实做到公司经济效益与社会效益、短期利益与长远利益、自身发展与社会发展相互协调，努力实现公司与员工、公司与社会、公司与环境的健康和谐发展。公司遵纪守法，合规经营，通过不断完善治理结构，持续加强风险管理和内部控制，努力提升经营业绩；强调以客户为中心，不断加强客户服务和提升客户满意度，并积极响应国家政策，全心全意为中小企业发展提供良好的融资和顾问等服务，积极协助中小企业拓宽融资渠道；通过推行公平合理的薪酬制度、安排岗位和职业技能培训等，保障员工合法权益、做好员工职业发展规划；关心员工身心健康，举办员工运动会、摄影比赛等多种活动，丰富员工业余生活，推动社会的和谐发展。

(5) 企业文化

“实现国人财富梦想，助推实体经济发展，为社会创造价值”是公司的使命，“与客户共生共荣”是公司的经营理念，“勤奋、团结、真诚、坚毅、平等、开放”是公司的行为准则。公司以新老员工培训为抓手，确保企业文化核心理念入脑入心；通过定期举办各类文体活动，培养员工践行公司文化的意志和实践能力，使公司具有自身特色的企业文化深入全员并贯彻到员工的日常行为中。同时，公司董事、监事和高级管理人员在企业文化建设中自觉发挥主导和示范作用；公司持续将企业文化建设融入到经营管理中，切实做到文化建设与发展战略有



机结合，增强了员工的责任心和使命感，引导和规范了员工行为，形成了团队的整体向心力，促进了企业的发展。

2. 风险评估

公司建立了全面风险管理体系，建立了四个层级组成的风险管理组织架构。第一层级为董事会及其下设的风险管理委员会，第二层级为执行委员会及其下设的风险管理专业委员会和首席风险官，第三层级为风险管理部、合规法律部、稽核审计部等风险管理部门，第四层级为各业务部门和分支机构。公司风险管理组织架构各层级的职责和分工如下：

公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，负责制定风险管理战略和风险管理政策，确定风险管理原则，根据环境的变化和业务的发展不断检验风险管理政策的有效性以使其不断完善，并将风险管理纳入整体经营发展战略。董事会下设风险管理委员会，主要负责研究制定公司总体风险控制和风险管理政策，审查公司风险控制体系及其有效性，监控、检查公司经营管理和业务运作，审查公司内部风险控制制度的落实情况，研究制定公司重要风险的界限以及董事会赋予的其他职责。

公司执行委员会是公司全面风险管理工作的组织机构，负责在董事会授权范围内，审批公司风险限额的分配方案、各项业务的风险额度、净资本补足方案，负责净资本补足方案的具体实施等董事会授权事项。公司执行委员会对公司全面风险管理的有效性承担主要责任。执行委员会下设风险管理专业委员会，主要负责对公司的整体风险状况进行评估，研究确定公司风险控制指标，对公司的总体风险管理进行监督，以确保与公司经营活动相关的各种风险控制合理的范围内。

公司首席风险官负责统筹公司风险管理工作，执行风险管理专业委员会制定的风险管理政策；制定风险管理的程序和操作规程，并监督其实施情况；有效识别、计量、监测和控制各项业务所承担的风险；对风险评估报告、创新业务方案进行审查。

公司风险管理部、合规法律部、稽核审计部是公司的专职风险管理部门，分别独立行使相应的风险管理职能，并负责沟通协调财务核算部、资金计划部、品牌管理部、信息技术部等公司内部控制部门对公司面临的市场、信用、流动性、操作、合规、法律、声誉等主要风险进行事前、事中和事后管理。

公司各业务部门及分支机构负责人为本部门风险管理的第一责任人，负责履行一线风险管理职能，按照公司风险管理的要求，将风险管理覆盖到所有业务流程和岗位。公司各业务部门及分支机构设立了履行合规与风险管理职责的专岗，协助本部门负责人对所开展的业务



进行风险识别、评估、管理和控制。

公司在开展新业务、新产品、扩大现有业务规模前，由风险管理部、合规法律部与业务部门共同负责进行合规性审查及风险评估工作，综合分析最大可能的风险水平是否在公司可承受的范围内。合规法律部通过审查部门业务规章制度、各种对外合同的合规性，对各项业务的风险进行事前控制。公司在办公流程中嵌入了合规审查和风险评估节点，合规法律部和风险管理部归口人员通过对流程的处理，及时识别、评估和处理证券自营业务、资产管理业务、投资银行业务、融资融券、股票质押式回购交易业务、经纪业务、全国中小企业股份转让系统做市业务等各类业务中的风险。

合规法律部、风险管理部负责分别对经纪业务、证券自营业务、资产管理业务、融资融券、股票质押式回购交易业务、全国中小企业股份转让系统做市业务、交易类创新业务、净资本及相关风险控制指标进行监控，对监控中发现的异常事项进行警示、上报并报送相关部门，通过实时监控系统的实现各项业务风险的事中控制，并对业务风险进行不定期评估。

稽核审计部通过现场稽核、非现场稽核、专项稽核等多种稽核方式对各项业务的合法合规性、内部控制的有效性进行独立的内部审计，对各项业务风险进行事后控制，对公司内部控制的健全性、有效性进行评价。

3. 控制活动

(1) 经纪业务内部控制

公司总部设立了经纪业务管理部门，对经纪业务进行管理，各分支机构在公司授权范围内开展具体业务。公司通过健全制度流程规范、加强业务流程集中式管理、实时监控与事后稽核检查相结合等方式强化对经纪业务的控制：

公司统一制定了经纪业务标准化业务内部控制制度和操作流程，从制度上加强对分支机构的风险控制，为业务操作规范化提供了制度依据。公司根据监管要求建立健全了账户管理制度，并严格依据制度加强对账户的日常管理，避免新开不合规账户；公司制定了营销管理制度，从人员聘用、岗前培训、执业资格管理、执业行为管理、薪酬与考核等方面防范营销风险；公司制定了包括客户适当性管理、客户回访和投诉处理等在内的客户管理和服务制度，规范了客户管理和客户服务相关工作，保护投资者合法权益；公司制定了培训制度，并有针对性地分支机构人员持续进行投资者适当性管理和合规执业等培训，提升合规执业意识，防范业务风险。

公司加强业务流程式集中管理，已实现法人集中清算，对交易和结算权限集中管理，前



后台业务分离；分支机构的人员权限由总部统一授权，对具有较高风险的特殊业务权限，采用的“临时授予、及时取消”授权操作原则；分支机构的关键岗位实行双人负责制，对相关岗位和人员实行恰当的责任分离，实现资金与账户、资金与委托等不相容岗位的分离；分支机构的公章由公司总部集中保管和审核使用，财务专用章及负责人名章由相关岗位分别保管和审批用印，业务专用章实行统一刻制和分类用印，并不定期对用印情况进行检查。

公司在各分支机构设立了合规风控岗，以及时识别和化解风险隐患，提升业务一线的风险控制水平；公司合规法律部对经纪业务进行合规审查、实时监控与预警、合规检查；稽核审计部对经纪业务制度和业务流程执行的有效性进行事后稽核，对分支机构负责人实行强制离岗稽核机制，防范人员道德风险。

(2) 期货 IB 业务内部控制

公司制定了《中间介绍业务管理办法》、《中间介绍业务内部控制细则》、《中间介绍业务风险隔离制度》、《中间介绍业务合规检查细则》、《中间介绍业务对接规则》、《中间介绍业务信息系统管理办法》、《中间介绍业务人员岗位职责》等制度，对期货 IB 业务操作、适当性管理、投资者教育、投诉处理等多个方面进行了规范。公司运营管理部负责对期货 IB 业务的集中统一管理；公司合规法律部、风险管理部和稽核审计部为期货 IB 业务事前、事中、事后的监督检查责任部门，负责对期货 IB 业务开展合规检查、持续风险监测和稽核审计，及时揭示重大业务风险。2015 年，公司期货 IB 业务运行合规，控制有效。

(3) 投资银行业务内部控制

公司根据法律法规和监管规定，建立健全了投资银行业务管理机制和制度，涵盖了：投资银行业务管理架构及内部运作；投资银行业务的风险管理及问核制度；项目承揽、尽职调查、现场工作、项目立项、上市辅导、申报内核、在会审核、发行上市、持续督导以及文件制作、项目底稿、工作日志等业务工作中的管理规范；投资银行业务的质量评估体系；客户服务的管理制度等。

公司根据法律法规和监管要求，基于健全、有效、独立、制衡、落实等原则，建立健全了投资银行业务的管理体系。证券发行内核委员会是投资银行业务最高决策机构，负责制定投资银行业务发展战略与规划，制定投资银行业务发展的重大政策，对重大问题进行决策等；内核机构负责投资银行业务项目的内核工作；投资银行总部、北京证券承销分公司和并购融资总部是投资银行业务的执行机构；风险管理部负责对投资银行项目上报材料的内部复核与风险评估；合规法律部负责对 IPO、再融资、并购重组等投资银行项目立项进行利益冲突检索、



对未公开信息申报、信息隔离墙建设等事项实施合规审查；稽核审计部负责对投资银行业务及其相关部门的稽核审计工作，承担检查、评价、报告和建议等职能。

公司注重投资银行业务流程设计的科学性和时效性，并根据实际情况，多次进行优化和调整，将投资银行业务流程分为项目承揽、立项审查、内核、项目申报、路演询价、发行上市、持续督导等阶段，并对每个环节的工作内容及风险防范作了具体规定。公司对投资银行业务项目实行专业审核与程序控制，遵循业务承揽与立项审核分离，项目承做与质量控制分离，发行定价与业务承做分离等内控原则。公司对包括并购重组在内的财务顾问项目实行全程管理，并且按照监管规定，对相关未公开信息予以全面、持续的隔离管理。

(4) 自营业务内部控制

公司制定了《投资业务管理规定》、《自营业务账户管理实施细则》、《风险控制管理细则》、《决策授权细则》等规章制度，对自营决策程序、信息管理、交易实施、会计核算、止盈止损、证券池制度、风险监控等进行了详细规定。

公司自营业务建立了多层次的投资管理和风险防范体系，制定了严谨的投资决策和操作程序及事前、事中、事后的风险控制流程。公司自营业务部门实行严格的岗位分工和权限管理，自营业务的调查研究、投资决策、交易执行、资金清算、运营维护等职责人员岗位分离。自营业务中的规模审批、账户管理、额度调拨、预警触发、风险提示等重要事项予以书面记录或者系统留痕。

公司风险管理部按照《证券公司证券自营业务指引》等法律法规、规则的相关规定和公司执行委员会、投资决策委员会决议的要求，对自营业务的操作行为、持仓状况、盈亏状况等指标进行实时风险监控，重点防范自营业务的规模失控、超越授权、账外自营、操纵市场、内幕交易等风险，确保自营业务各项风险指标符合监管指标的要求并控制在公司承受范围内。合规法律部和稽核审计部定期或不定期地对自营业务进行合规检查和稽核审计，确保有效防范和化解自营业务中存在的风险。

(5) 资产管理业务内部控制

公司建立了严密有效的多级风险防范体系，明确了公司资产管理业务的内部控制重点是防范内幕交易、利益输送、决策失误、越权操作、挪用客户资产、保本保底承诺及其他损害客户利益所导致的风险，并将资产管理业务的风险管理工作纳入其中。

公司建立了资产管理委员会、投资决策委员会的两级决策体系，决策和授权过程清晰，权责统一，权限设定、授权审核和交易能够得到合理控制。



公司建立了较为完善的资产管理业务规章制度，注重资产管理业务的风险管理，设立投资、研究、交易、风险控制、产品设计、运营、核算等不同岗位，形成各司其职，相互配合和支持的营运系统，实现了决策、执行和监督三个环节的相互独立、相互制衡，有效地控制了风险。公司建立健全了相应的风险控制制度和合规管理制度，采取了有效措施，将客户资产管理业务与公司的其他业务分开管理，控制敏感信息的不当流动和使用，防范内幕交易和利益冲突。

资产管理分公司设专人根据内部风险控制制度对产品设计与创新、市场营销、投资决策、交易执行、清算、客户服务等业务环节中存在的风险进行前台控制，保证资产管理业务稳健规范运行。风险管理部负责执行日常风险识别、评估、监测与报告，确保客户资产的安全性。公司合规法律部事前、事后对资产管理业务进行审核和检查，稽核审计部定期或不定期地对资产管理业务进行专项稽核，及时发现并纠正内控缺陷，督促规范运作。

(6) 信用业务内部控制

公司对融资融券、股票质押式回购业务实行集中管理和授信、分级审批、独立运行的业务模式，制定了《融资融券业务管理办法》、《融资融券业务合规管理办法》、《融资融券业务风险管理办法》、《股票质押式回购交易业务管理制度》、《股票质押式回购交易业务风险管理办法》等制度，覆盖了征信授信、信用账户管理、担保物和标的管理、逐日盯市、强制平仓、客户服务等业务环节，并通过在相关系统中设置监控指标和阈值等方式，对业务进行主动盯市与预警，及时揭示业务风险动态变化，有效化解潜在风险。

(7) 证券投资咨询业务内部控制

a. 研究业务内部控制

公司研究业务建立了涵盖研究报告审批与发送、投资咨询、研究业务合规管理等领域的制度体系。公司注重提高研究报告的质量水平与合规程度，由专职岗位审核研究报告的格式与内容，重点核查研究报告的资料来源、信息披露合规性等情况，并且在系统中完整保存公司研究部门所发布的研究报告。公司严格执行信息隔离墙、未公开信息知情人管理等方面的监管规定，对“跨墙”行为采取了内部审批、保密承诺等控制措施。合规法律部指定专人负责研究所业务合规工作，定期或不定期对证券研究业务进行合规检查，稽核审计部对研究业务进行定期或不定期的内部稽核审计。

b. 证券投资顾问业务内部控制

证券投资顾问业务由公司产品服务部统一组织及管理，证券投资顾问业务和证券研究业



务、自营业务、资产管理业务、投行业务间建立了严格的“隔离墙”制度。公司制定了证券投资顾问人员管理、资格注册、签约管理、证券投资顾问服务、绩效考核、客户回访等各环节的管理制度和业务流程规范，日常通过客户服务系统实施规范化管理和内部控制。合规法律部对投资顾问业务进行实时监控和定期、不定期的检查，稽核审计部对证券投资顾问业务进行定期或不定期的内部稽核审计。

(8) 全国中小企业股份转让系统业务内部控制

a. 全国中小企业股份转让系统做市业务内部控制

公司设立场外市场部，配备合格专业人员，负责开展全国中小企业股份转让系统的做市业务。为规范开展新三板做市业务，公司制定了较为健全的做市业务制度体系，涵盖了做市股票报价、做市库存股票管理、做市资金管理、业务隔离、异常情况处理、内部报告与留痕、风险控制与合规管理等方面。

公司建立了做市业务决策、授权体系，明确做市业务的决策机构与决策机制，合理确定做市业务规模和可承受的风险限额。公司做市业务采取“公司战略发展委员会、执行委员会—新三板业务委员会—做市业务委员会—场外市场做市决策会议”的四级决策与授权体系。公司战略发展委员会和执行委员会是公司自有资金投资方向的决策机构，负责确定公司做市业务的总体规模、对新三板业务委员会进行做市业务授权等；新三板业务委员会是公司股转系统业务的决策机构，负责对做市业务委员会进行做市业务授权、审议做市业务委员会提交的做市业务的申请或报告等；做市业务委员会是公司做市业务的最高决策机构，在授权范围内负责做市业务的决策和授权，负责在授权范围内对做市业务规模、资金规模、风险限额等重大事项进行决策，审议做市计划、做市股票池的建立和调整，监督做市业务执行，审定重大风险事项的处置等；场外市场做市决策会议为做市业务的议事决策机制，在做市业务委员会的授权范围内负责做市业务的审议、决策和授权。

场外市场部负责做市业务的具体管理和运作，严格按照公司做市业务操作规程进行操作。公司开展做市业务，通过专用证券账户、专用交易单元进行，与自营账户、证券经纪账户相互独立。做市业务与证券投资咨询、证券自营、证券经纪、证券资产管理等业务在机构、人员、信息、账户、资金上严格分离，防范内幕交易，避免利益冲突。做市系统对操作进行全留痕，对报价和成交数据等留有完整、准确、详实的记录或者凭证。

场外市场部作为一线风险控制部门，具体负责做市业务的各项动态风险监控工作，根据做市业务委员会下达的做市业务规模和风险限额等，对做市业务进行实时监控，通过逐日盯



市及时识别业务所涉及市场风险及流动性风险，如果出现异常情况，按照规定向相关人员和部门进行预警、报告；风险管理部作为做市业务风险管理专职及协调部门，负责风险指标管理、动态监控做市业务，全面控制做市业务风险；合规法律部负责做市业务流程、制度审核、定期和不定期对做市业务的实际运作情况进行合规检查；稽核审计部负责对做市业务进行定期和不定期的稽核审计。

b. 全国中小企业股份转让系统推荐业务内部控制

公司设立业务管理部负责全国中小企业股份转让系统推荐业务，制定了《全国中小企业股份转让系统推荐业务管理办法》、《全国中小企业股份转让系统推荐业务内核管理办法》、《全国中小企业股份转让系统推荐业务立项管理办法》、《全国中小企业股份转让系统推荐业务尽职调查工作底稿实施细则》、《全国中小企业股份转让系统挂牌公司信息披露与持续督导管理办法》等制度。全国中小企业股份转让系统推荐业务与证券研究、经纪、自营、资产管理等业务之间建立了严格的“隔离墙”制度，在信息、人员、账户等方面相互隔离，防止利益冲突、内幕交易和操纵市场行为的发生。

推荐业务实施过程中，立项委员会、内核委员会、业务管理部和各项目组各司其职，严格履行项目签约、项目执行、材料申报、持续服务等业务环节的相应职能。公司对推荐业务建立了检查机制，合规法律部、风险管理部对推荐业务进行审查、风险评估和检查，稽核审计部对推荐业务进行定期或不定期的内部稽核审计。

(9) 会计内部控制

公司实行统一管理、计划控制、分级核算、利润集中的财务管理体制。公司资金计划部和财务核算部统一管理全公司财务会计工作，负责制订各项财务会计制度，指导、监督各核算单位财务会计工作。各核算单位财务部门根据公司制订的各项财务会计制度，制订本单位具体实施方法，并上报公司资金计划部和财务核算部备案后，严格按制度执行。每年年初，董事会确定财务目标，制定公司年度收支计划，并将其下达至各核算单位。各核算单位负责组织实施财务收支工作。公司资金计划部、财务核算部对各核算单位计划执行情况进行监督、检查，对计划完成情况进行考核。各核算单位实行单独核算。公司财务核算部负责全公司的报表合并，并以法人为单位对外提供报表。

公司和营业部执行统一的财务管理规定和会计核算办法，营业部财务经理由公司直接委派和管理，由公司财务核算部对各营业部实行垂直管理。财务核算部负责公司的集中核算管理，全公司建立统一核算账簿，公司及各营业部的账簿均为统一账簿的有机组成部分。公司财务



管理系统采用统一的财务软件，覆盖了财务核算、预算管理、费用报销等方面，实现了公司会计核算网络化与核算数据集中，也实现了集中式的财务管理及对各营业部财务数据的监控。营业部财务经理和出纳的岗位职责相互制衡。资金划拨业务由出纳填单，审核由财务经理进行，资金支付必须经营业部总经理签字确认后办理。清算、经营费用等账务处理由财务经理、出纳分别记账、审核。

财务系统权限设置由财务核算部统一制定，根据双人复核分责、相互监督制衡、岗位分离等原则，对岗位权限进行统一分配。在账务处理系统、原始单据、记账凭证、各种账簿、报表等方面相互独立，分别核算客户资金和自有资金。营业部每日进行数据对账工作，以便及时发现异常情况，迅速采取措施，避免风险发生或扩大。

公司制定了《财务会计报告办法》，对报告编制、对外提供和分析利用进行全过程的管理，明确了相关工作流程和要求，按照公司及外部监管部门的要求，及时编制财务报表、监管报表等，报表内容做到真实、准确、完整。

(10) 资金内部控制

公司对自有资金和客户资金在账户设置、审批权限、管理人员和流程上严格分离。

公司制定了《自有资金管理办法》，自有资金管理的原则是：统一调度、头寸集中、垂直管理、有偿使用、分工负责。统一调度是指由总部负责全公司资金的统一调度和分配。头寸集中是指各部门及分支机构在保留正常业务所需的头寸后，应将富余头寸及时归还到总部。垂直管理是指各部门及分支机构之间不得相互调拨资金，严禁单独对外融资，如有融资需求，必须报经总部批准。有偿使用是指总部对各部门及分支机构进行内部资金转移定价管理，根据公司经营战略及实际情况确定利率水平，计入各部门及分支机构考核成本。分工负责是指总部、其他各部门及分支机构应根据本制度的有关规定，各负其责，既要相互沟通与配合，又要相互监督，保障资金安全。公司自有资金账户实行统一管理，分支机构银行账户的开立、变更、撤销等需经公司总部审批。

公司实行全面预算制度。公司总部各部门及分支机构根据公司总的年度预算，编制各预算单位的预算。公司各项预算是公司年度计划确定的全年经营活动和经营目标的系统化、具体化体现，是公司组织经营活动的依据。预算的执行结果，是对公司和各预算单位工作考核的重要依据之一。资金计划部负责公司总部各部门及分支机构预算管理的日常工作，内容包括：组织、指导各预算单位编制预算；负责各预算单位预算的汇总、形式审查及报告；负责预算方案的实施监控，对预算执行情况进行跟踪分析与考核；负责预算总量的控制及为预算



控制提供数据、信息支持等。

公司制定并严格执行费用管理办法，实行“必要、节约、合理、属实”的开支原则，采取“预算管理，标准控制”的管理方法，加强费用预算控制，明确费用标准，严格备用金借款管理和费用报销审批程序，保证了费用开支的合理性、合法性、真实性。

公司资产托管部作为客户资金的管理部门，负责公司交易资金的集中管理、统一结算、统一调度、统一核算，独立履行客户证券和资金的存管、登记、清算、交收等职能。公司证券自营业务与经纪业务在人员、信息、账户、资金和会计核算上严格分离。资产托管部根据集中柜台交易系统、法人清算系统、会计核算系统及客户资金专用存款账户的相关数据，对客户资金及股份数据进行核对，做到客户资金账实相符，保证客户资金的安全、完整。通过对各系统的客户资金数据的勾稽核对，对存在问题的数据，分析原因，提出解决办法，使风险尽可能减少并得到控制。

(11) 信息系统内部控制

公司信息技术工作由信息技术部统一归口管理。信息技术部是全公司信息系统规划、建设、运行、管理与维护的主管部门，负责公司信息系统的日常维护管理以及与公司信息技术相关的联系工作。公司信息技术应用管理实行集中统一管理的原则。集中统一管理是指在公司系统内，以统一规划、统一标准、统一应用、统一实施的方式，分布实施推广计算机应用技术。公司信息系统的立项审批与开发、运行与维护、开发测试与日常运转之间进行了适当分离。

集中交易系统机房按照国家 A 类机房标准建设，具有完备的不间断电源、消防、防雷接地和温湿度控制系统。机房内资金服务器通过实时备份程序实现实时备份和温备功能，保证了交易系统核心资金服务器的安全、稳定、可靠运行。

机房内使用的主交换机与路由器，均采用主、备模式，实现双链路、双冗余备份，保证网络系统的正常稳定运行。集中交易运行中心和有现场客户营业网点之间至少存在两条不同介质的通讯通道（专线和 VPN），保证业务运行的可靠性与连续性。集中交易系统通过地面线路和卫星两种通信方式与深、沪两交易所连接，并实现了天地互备、自动切换。所有涉及与外网或公网的连接，如网上交易等均通过专用防火墙屏蔽。集中交易系统软件采用行业内技术较为成熟的恒生经纪业务管理平台 V2.0。在网络中采用趋势网络版防病毒软件，对各网段进行实时病毒监控。关键信息系统采用密码策略，对密码复杂度等要素进行控制。

公司建立了完善的运行监控系统，对集中交易系统的运行环境、运行状况进行实时监控



（包括服务器、报盘系统、数据库、存储系统、网络和通信线路等），并提供多种报警手段；定期分析监控系统的记录，做到防患于未然。异地应用级的集中交易灾难备份中心与集中交易系统同步建成，可在 20 分钟左右完成业务系统接管，恢复全公司的证券交易业务。为保证集中交易灾难备份系统的使用安全，确保集中交易灾难备份系统启动时机正确及时，公司专门制定了《集中交易系统灾备启用细则》及《UF2.0 灾备切换操作文档》，详细规定了集中交易灾难备份系统启用条件、审批流程及具体操作规程。

公司建成了以集中交易中心机房和灾备中心机房两数据中心机房为核心节点的公司级广域网。公司各分支机构与两数据中心机房均具备通讯线路连接，能够有效防范系统风险。公司办公网络和交易网络物理隔离，交易网络包括集中交易、集中清算、集中财务、客户资金管理业务、风险控制系统等与交易业务相关的业务系统，办公网络包括 OA 自动办公系统、视频会议、邮件等与办公相关的应用系统。

公司建立了信息系统内部审计机制，稽核审计部定期或不定期的进行信息系统专项审计，及时发现、纠正信息系统内部控制中的薄弱环节。

(12) 合规管理

公司建立了与管理模式相适应的合规管理组织架构，并以合规管理组织架构和制度体系的持续完善为重心，不断深化公司合规管理工作，形成了适应公司经营发展的合规管理长效机制。

合规总监是公司的合规负责人，对公司经营活动及工作人员执业行为的合法合规性进行审查、监督和检查。公司制定了合规管理制度，明确了各层级合规管理职责，全面梳理和完善了公司的各项规章制度，明确了各部门、各岗位的职责和问责机制，完善了权限审批的控制机制和流程，并将合规管理的节点全面嵌入到了公司制度和业务流程中，覆盖了公司经营管理的各个方面。合规法律部协助合规总监对公司及工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查，履行合规审查与咨询、合规检查与监测、合规培训与宣导、信息隔离墙建设、反洗钱等合规管理职责。公司在各业务部门、各分支机构设合规风控岗，协助所在部门负责人对本部门及其员工的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督、检查和报告。

(13) 反洗钱内部控制

公司成立反洗钱管理委员会，由公司总裁任主任，合规总监、财务总监及负责经纪业务的副总裁为副主任，合规法律部、风险管理部、资产托管部、营销管理部、产品服务部、运



营管理部、资金计划部、财务核算部、稽核审计部、信息技术部等相关部门的负责人为组员。

公司制定了《反洗钱工作内部控制基本规定》等反洗钱工作制度，明确了各部门、各岗位的反洗钱工作职责范围，细化了反洗钱工作的各个环节。公司根据《反洗钱工作内部控制基本规定》，积极开展客户身份识别、重新识别和持续识别工作。公司合规法律部通过合规管理系统对大额交易和可疑交易进行监测，对监测到的可疑信息通过多种方式进行甄别和核实，并认真履行报送义务。公司认真落实反洗钱宣传和培训工作，将反洗钱培训工作纳入合规培训范围，同时，各营业部积极开展面向客户的宣传活动，提高客户对反洗钱工作的认识。

(14) 信息隔离墙内部控制

为防止敏感信息在有利益冲突的部门之间相互流动，以防止滥用信息优势，避免产生利益冲突和内幕交易，公司完善了信息隔离墙制度和机制。明确了董事会和经营管理的主要负责人对公司信息隔离墙制度的总体有效性负有最终责任；公司各业务部门、分支机构的负责人对本部门和本机构执行信息隔离墙制度的有效性承担管理责任；公司合规总监和合规法律部协助董事会和经理层建立和执行信息隔离墙制度，并负有审查、监督、检查、咨询和培训等职责；公司员工对其个人在执业活动中违反信息隔离墙制度承担直接责任。

公司确保了投行业务、研究业务、经纪业务、自营业务、资产管理业务分属不同的领导管辖，所有业务人员严格分离，禁止相互兼职，实现了上述部门在业务、人员、物理空间与账户管理方面的全面隔离，并通过合规管理系统为信息隔离墙制度提供了技术实现手段。公司合规总监领导合规法律部通过建立合规检查、名单管理、跨墙管理等机制，对敏感信息的不当流动和使用风险进行监管。

(15) 对控股子公司的管理与控制

公司制定了《子公司管理办法》，通过对子公司选派董事、监事，促进子公司完善公司治理，健全内部控制机制，切实防范母公司与子公司之间的风险传递和利益冲突。公司董事会办公室是子公司事务的归口管理部门，负责与控股子公司进行沟通，及时了解控股子公司业务动态和财务数据，以保障公司权益，提高投资效益。公司控股的天风期货和全资子公司天风天盈、天风天睿均严格依据《公司法》等法律法规的规定建立了健全、有效的内部控制组织体系和规章制度体系，规范运作，合规经营。

4. 信息与沟通

(1) 信息沟通

公司建立了内部办公自动化系统，通过其发布各类规章制度、通知公告等，使广大员工



能及时获取公司管理信息，并将授权控制、流程状态跟踪等功能固化至系统中，在加强内部沟通效率的同时，实现了工作留痕。

公司各部门、各业务线以及各子公司之间建立了明确的管理和汇报机制，保证内部信息及时、有效、准确传递。

公司制定了风险管理制度、合规管理制度、财务管理制度和稽核管理制度，要求相关单位定期或不定期报告各项业务经营中的风险、合规及财务数据情况。

公司股东大会、董事会、监事会按照《公司法》、《公司章程》召开会议听取并决策公司经营管理工作、风险管理及内部控制等事项；公司定期召开执行委员会，研究和部署重大经营管理工作。

公司设立了统一的客户投诉电话和邮箱，并对外公布，客户可通过电话、电子邮件、信函等方式向公司总部、分支机构、呼叫中心等进行投诉。针对不同的投诉，公司责成相关单位进行妥善处理。

(2) 信息披露

公司根据《公司法》、《证券法》等相关法律、行政法规及其他规范性文件的规定，制定了《信息披露事务管理规定》，对信息披露的基本原则、信息披露的内容及标准、信息披露的职责、信息披露的程序、信息披露的档案管理、信息披露的责任等做了明确规定。公司董事会秘书负责信息披露事务，对公司和董事会负责。公司董事会办公室是公司信息披露事务的具体执行机构，根据监管要求，定期或不定期完成各项对外材料的编撰报送。

截至2015年12月31日，公司严格按照内外部规定的要求，认真履行了信息披露义务。

5. 内部监督

公司建立健全了董事会审计委员会、监事会、内部控制部门等组成的全方位、多层次内部监督体系。董事会审计委员会协助董事会独立地审查公司财务状况、内部控制制度的执行情况及其效果，对公司内部稽核审计工作结果进行审查和监督。监事会负责对公司董事、监事、高级管理人员以及公司经营管理情况、财务状况进行监督，向股东大会负责并报告工作。同时，公司稽核审计部、合规法律部和风险管理部等内部控制部门分工协作，对各项业务的内部控制情况进行定期或不定期的监督检查。

截至2015年12月31日，公司未发生重大违规事项。

(二) 内部控制评价工作依据及内部控制缺陷认定标准

公司依据企业内部控制规范体系及《天风证券股份有限公司内部控制基本规定》等相关



法律、法规、监管规则、自律规则和内部管理制度的要求，组织开展内部控制评价工作。

公司董事会根据企业内部控制规范体系对重大缺陷、重要缺陷和一般缺陷的认定要求，结合公司规模、行业特征、风险偏好和风险承受度等因素，区分财务报告内部控制和非财务报告内部控制，研究确定了适用于本公司的内部控制缺陷具体认定标准。公司确定的内部控制缺陷认定标准如下：

1. 财务报告内部控制缺陷认定标准

公司确定的财务报告内部控制缺陷评价的定量标准如下：

编号	项目	一般缺陷	重要缺陷	重大缺陷
1	与资产负债表相关的潜在错报	错报金额 \leq 资产总额的 0.5%	资产总额的 0.5% < 错报金额 \leq 资产总额的 1%	错报金额 > 资产总额的 1%
2	与利润表相关的潜在错报	错报金额 \leq 营业收入的 1%	营业收入的 1% < 错报金额 \leq 营业收入的 5%	错报金额 > 营业收入的 5%

公司确定的财务报告内部控制缺陷评价的定性标准如下：

(1) 出现下列情形的，公司认为财务报告内部控制存在重大缺陷：

- a. 董事、监事或高级管理人员发生与财务报告相关的舞弊行为；
- b. 监管机构责令公司更正已公布的财务报告；
- c. 被外部审计机构出具保留意见、否定意见或无法表示意见的审计报告。
- d. 公司对内部控制的监督无效。

(2) 出现下列情形的，公司认为财务报告内部控制存在重要缺陷：

- a. 未依照公认会计准则选择和应用会计政策；
- b. 对于期末财务报告过程的控制存在一项或多项缺陷且不能合理保证编制的财务报表达到真实、完整的目标。

(3) 财务报告内部控制一般缺陷指不符合上述重大缺陷、重要缺陷标准的其他财务相关内部控制缺陷。

2. 非财务报告内部控制缺陷认定标准

公司确定的非财务报告内部控制缺陷评价的定量标准如下：

根据单独缺陷或多个缺陷的组合直接导致未能及时防止或发现并避免的财产损失金额划分：

项目	一般缺陷	重要缺陷	重大缺陷
因内控缺陷造成的损失占净资产的比例	小于 1% (含)	1%-3% (不含)	3%以上 (含)



公司确定的非财务报告内部控制缺陷评价的定性标准如下：

- (1) 公司存在下述迹象之一的，通常表明非财务报告内部控制存在重大缺陷。
 - a. 公司重大决策缺乏决策程序或程序严重不合理且造成重大损失；
 - b. 公司人员发生严重违反国家法律、法规事项，并给公司造成重大损失和严重不利影响；
 - c. 发生证券期货行业规定的信息安全特别重大事件；
 - d. 内部控制评价的结果是重大缺陷但未得到整改。
- (2) 公司存在下述迹象之一的，通常表明非财务报告内部控制存在重要缺陷。
 - a. 公司重要决策程序出现程序失误且造成较大损失；
 - b. 公司人员已经或者涉嫌舞弊并给公司造成重大损失；
 - c. 发生证券期货行业规定的信息安全重大事件；
 - d. 内部控制评价的结果是重要缺陷但未得到整改。
- (3) 一般缺陷指除重大缺陷和重要缺陷以外的其他缺陷。

（三）内部控制缺陷认定及整改情况

1. 财务报告内部控制缺陷认定及整改情况

根据上述财务报告内部控制缺陷的认定标准，报告期内公司不存在财务报告内部控制重大缺陷、重要缺陷。

2. 非财务报告内部控制缺陷认定及整改情况

根据上述非财务报告内部控制缺陷的认定标准，报告期内未发现公司非财务报告内部控制重大缺陷、重要缺陷。

四、其他内部控制相关重大事项说明

公司无其他内部控制相关重大事项说明。

董事长：

天风证券股份有限公司
二〇一六年二月二十四日







营业执照

(副本) (6-3)

注册号 110108014689085

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日 至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



在线扫码获取详细信息

登记机关



2015 年 08 月 10 日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。





证书序号: NO.006855

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批,准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的,应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止,应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



中华人民共和国财政部制



会计师事务所 执业证书

名称: 大信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 吴卫星
办公场所: 北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

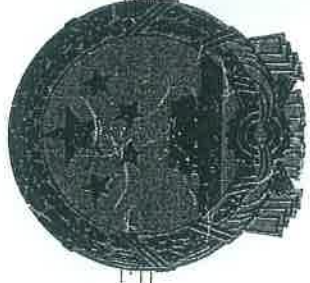
组织形式: 特殊普通合伙

会计师事务所编号: 11010141

注册资本(出资额): 2920万元

批准设立文号: 京财会许可[2011]0073号

批准设立日期: 2011-09-09



证书序号: 000162

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准
大信会计师事务所(特殊普通合伙) 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人: 吴卫星

证书号: 52

发证时间: 二〇一六年九月

证书有效期至: 二〇一六年九月





姓名	向辉
Full name	
性别	男
Sex	
出生日期	1978-06-07
Date of birth	
工作单位	大信会计师事务所有限公司
Working unit	大信会计师事务所湖北分所
身份证号码	420106197806072411
Identity card No.	



年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.

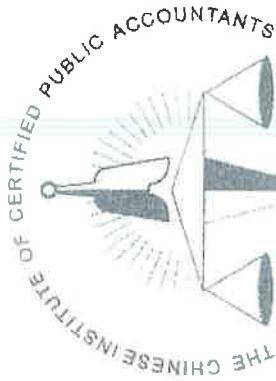


证书编号：
No. of Certificate 42000320472

批准注册协会：
Authorized Institute of CPA 湖北省注册会

发证日期：2007 年 月 日
Date of Issuance





中国注册会计师协会

姓名	郭晗
Sex	女
Date of birth	1982-09-26
Working unit	大信会计师事务所湖北分所
Identity card No.	4210221982092653420



年度检验登记

Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.



证书编号: 110100690058
No. of Certificate

批准注册协会: 湖北省注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2010 年 6 月 13 日
Date of Issuance





天风证券股份有限公司

客户资金安全审核报告

大信专审字[2016]第 2-00098 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.







大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

客户资产管理业务审核报告

大信专审字[2015]第 2-00098 号

天风证券股份有限公司：

我们接受委托，对天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）2014年度所从事的客户资产管理业务进行了审核。

一、管理层的责任

按照中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于修改〈证券公司客户资产管理业务管理办法〉的决定》（中国证监会令第93号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]29号）、《证券公司定向资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]30号）（以下简称“客户资产管理业务监管要求”）的规定从事客户资产管理业务、编制和公允列报客户资产管理业务监管报表是贵公司管理层的责任。

二、注册会计师的责任

我们的责任是对贵公司是否按照客户资产管理业务监管要求的规定从事客户资产管理业务发表审计意见。我们的审计是按照《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》进行的。在审计过程中，我们结合贵公司的实际情况，实施了检查、重新计算等必要的审计程序。我们相信，我们获取的证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，贵公司客户资产管理业务在所有重大方面符合客户资产管理业务监管要求的



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

规定，公允反映了贵公司2014年度客户资产管理业务的运营情况。

四、报告分发和使用限制的说明

本审计报告仅供贵公司管理当局参考及上报中国证券监督管理委员会使用，不得用于其他目的。因使用不当造成的后果，与执行本审计业务的会计师事务所及注册会计师无关。

附件：客户资产管理业务情况汇总表

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一五年三月十一日

客户资金情况表

2015年12月31日

单位：人民币元

目	期末数	期初数
1、客户资金来源		
代买卖证券客户资金	3,274,801,069.25	1,819,979,140.28
受托投资管理客户资金	35,972,125,182.32	23,746,939,304.66
来源小计	39,246,926,251.57	25,566,918,444.94
2、客户资金占用		
银行存款——代理买卖客户存款	2,133,529,229.82	1,043,567,551.68
银行存款——受托投资管理客户存款		
清算备付金——代理买卖证券客户	1,274,756,757.63	845,540,898.21
清算备付金——受托资产管理客户		
交易保证金	60,383,541.35	7,446,889.61
受托资产（包括已实现未结算的损益）	35,972,125,182.32	23,746,939,304.66
占用小计	39,440,794,711.12	25,643,494,644.16
3、挪用客户资金（若来源和占用差额为正）	-193,868,459.55	-76,576,199.22

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



客户交易结算资金安全性监管报表

填报单位：天风证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	人民币	美元	港币	折成人民币合计	
柜台交易系统资金余额	1				
经纪业务客户柜台交易系统资金余额	2	2,952,271,547.22	1,134,728.00	4,048,028.97	2,963,031,374.67
融资融券业务柜台客户交易系统资金余额	3	311,769,694.58	-	-	311,769,694.58
定向资产管理业务柜台客户交易系统资金余额	4				
	5				
经纪业务：	6				
代理买卖证券款—财务系统余额	7	2,952,271,547.22	1,134,728.00	4,048,028.97	2,963,031,374.67
银行存款—客户资金存款	8	2,127,330,545.41	673,630.20	2,177,659.23	2,133,529,229.82
结算备付金—客户备付金	9	766,730,688.75	310,075.32	3,166,340.88	771,396,890.93
存出保证金—交易保证金（客户）	10	58,211,379.35	270,000.00	500,000.00	60,383,541.35
经纪业务客户交易结算资金差额	11	-1,066.29	-118,977.52	-1,795,971.14	-2,278,287.43
	12				
融资融券业务：	13				
信用交易代理买卖证券款—财务系统余额	14	311,769,694.58	-	-	311,769,694.58
银行存款—客户信用资金存款	15	187,093,933.83	-	-	187,093,933.83
结算备付金—信用备付金	16	503,359,866.70	-	-	503,359,866.70
融资融券业务客户交易结算资金差额	17	-378,684,105.95	-	-	-378,684,105.95
	18				
定向资产管理业务：	19				
受托资金	20	35,972,125,182.32	-	-	35,972,125,182.32
银行存款—受托管理客户存款	21	52,073,177.08	-	-	52,073,177.08
结算备付金—客户备付金（受托管理客户）	22	-	-	-	-
受托投资	23	35,920,052,005.24	-	-	35,920,052,005.24
其中：投资成本	24	36,541,891,434.86	-	-	36,541,891,434.86
已实现未结算损益	25	-21,591,787.61	-	-	-21,591,787.61
存出与托管客户资金	26	-	-	-	-
定向资产管理业务客户交易结算资金差额	27	-	-	-	-
	28				
经纪客户透支金额：	29				
	30				
客户交易结算资金被质押、冻结情况：	31				
客户交易结算资金被质押金额	32				
客户交易结算资金被商业银行冻结金额	33				
客户交易结算资金被司法机关冻结金额	34				
客户交易结算资金被商业银行扣划金额	35				
客户交易结算资金被司法机关扣划金额	36				

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：





营业执照

(副本)⁽⁶⁻¹⁾

统一社会信用代码 91110108590611484C

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日 至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



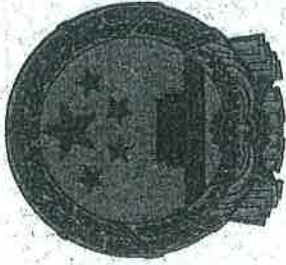
在线扫码获取详细信息

登记机关



2016年01月05日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。



会计师事务所 执业证书

名称：大信会计师事务所（特殊普通合伙）

主任会计师：胡咏华

办公场所：北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

组织形式：特殊普通合伙

会计师事务所编号：11010141

注册资本(出资额)：3130万元

批准设立文号：京财会许可[2011]0073号

批准设立日期：2011-09-09

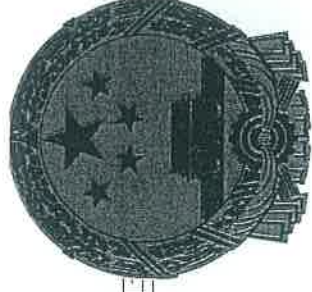
证书序号：NO. 019736

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



中华人民共和国财政部制



证书序号：000418

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

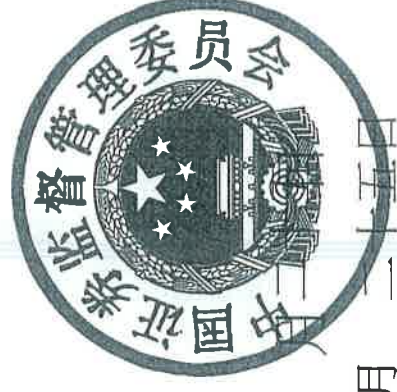
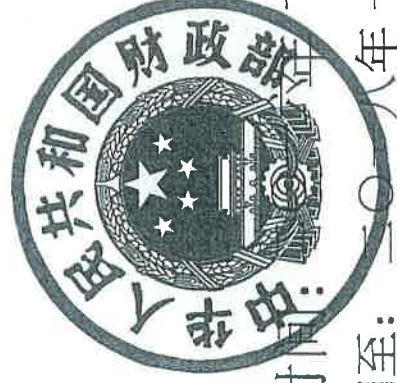
经财政部、中国证券监督管理委员会审查，批准
大信会计师事务所（特殊普通合伙） 执行证券、期货相关业务。

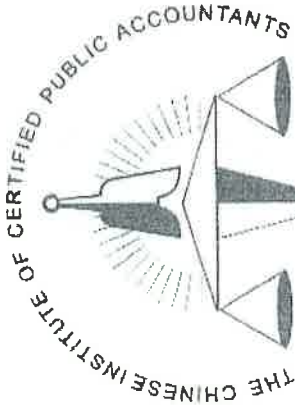
首席合伙人：胡咏华

证书号：08

发证时间：二〇〇八年一月二十五日

证书有效期至：二〇〇八年一月二十五日





姓名 向辉
 Full name 向辉
 性别 男
 Sex 男
 出生日期 1978-06-07
 Date of birth 1978-06-07
 工作单位 大信会计师事务所有限公司湖北分所
 Working unit 大信会计师事务所有限公司湖北分所
 身份证号码 420106197806072411
 Identity card No. 420106197806072411



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after this renewal.

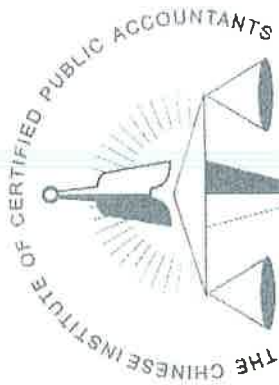


证书编号:
 No. of Certificate 42000320472

批准注册协会:
 Authorized Institute of CPA 湖北省注册会

发证日期: 2007 年 月 日
 Date of Issuance





中国注册会计师协会

姓名	郭哈
Full name	郭哈
性别	女
Sex	1982-09-26
出生日期	1982-09-26
Date of birth	大信会计师事务所湖北分所
工作单位	大信会计师事务所湖北分所
Working unit	421022198209263420
身份证号码	421022198209263420
Identity card No.	



年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经经验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.



证书编号: 110100690058
No. of Certificate

批准注册协会: 湖北省注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2010 年 6 月 13 日
Date of Issuance





天风证券股份有限公司
客户资产管理业务审核报告

大信专审字[2016]第 2-0099 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.







大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

客户资产管理业务审核报告

大信专审字[2016]第 2-00099 号

天风证券股份有限公司：

我们接受委托，对天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）2015年度所从事的客户资产管理业务进行了审核。

一、管理层的责任

按照中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于修改〈证券公司客户资产管理业务管理办法〉的决定》（中国证监会令第93号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]29号）、《证券公司定向资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]30号）（以下简称“客户资产管理业务监管要求”）的规定从事客户资产管理业务、编制和公允列报客户资产管理业务监管报表是贵公司管理层的责任。

二、注册会计师的责任

我们的责任是对贵公司是否按照客户资产管理业务监管要求的规定从事客户资产管理业务发表审计意见。我们的审计是按照《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》进行的。在审计过程中，我们结合贵公司的实际情况，实施了检查、重新计算等必要的审计程序。我们相信，我们获取的证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

我们认为，贵公司客户资产管理业务在所有重大方面符合客户资产管理业务监管要求的规定，公允反映了贵公司2015年度客户资产管理业务的运营情况。

四、报告分发和使用限制的说明

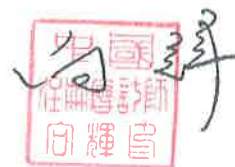
本审计报告仅供贵公司管理当局参考及上报中国证券监督管理委员会使用，不得用于其他目的。因使用不当造成的后果，与执行本审计业务的会计师事务所及注册会计师无关。

附件：客户资产管理业务情况汇总表

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一六年二月二十四日

定向资产管理业务情况汇总表

项目名称	户数	期末成本	期末市值	浮动 盈亏	已实现 未结算盈亏	备注
一、风险与收益不由证券公司承担						
受托资产：						
单一客户、定向资产管理业务	100.00	35,972,125,182.32	36,057,007,741.28			
其中：机构客户	90.00	35,322,925,182.32	35,428,295,465.70			
个人客户	10.00	649,200,000.00	628,712,275.58			
受托资金：	金额：35,972,125,182.32					
二、风险与收益由证券公司承担						
受托资产：						
单一客户、定向资产管理业务						
其中：机构客户						
个人客户						
受托资金：	金额：					
三、受托资金总计	金额：35,972,125,182.32					







营业执照

(副本)⁽⁶⁻¹⁾

统一社会信用代码 91110108590611484C

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日 至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



在线扫码获取详细信息

登记机关



2016 年 01 月 05 日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。





证书序号: NO. 019736

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



中华人民共和国财政部制

会计师事务所 执业证书

名称: 大信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 胡咏华

办公场所: 北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

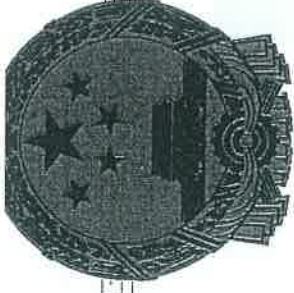
组织形式: 特殊普通合伙

会计师事务所编号: 11010141

注册资本(出资额): 3130万元

批准设立文号: 京财会许可[2011]0073号

批准设立日期: 2011-09-09



证书序号: 000418

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

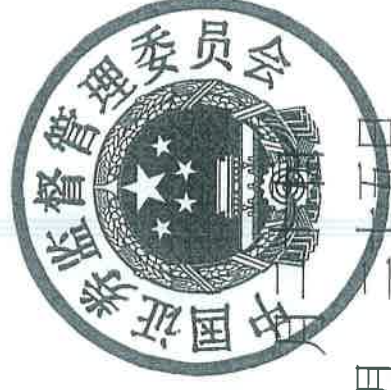
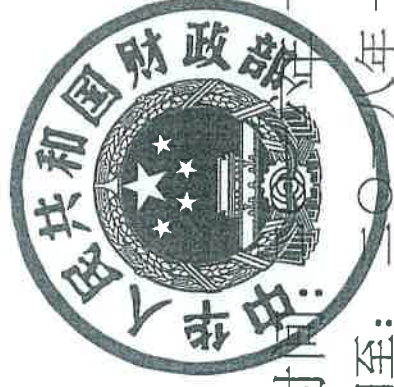
经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准
大信会计师事务所 (特殊普通合伙) 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人: 胡咏华

证书号: 08

发证时间:

证书有效期至:



二〇〇八年一月二十五日





姓名 向辉
 Full name
 性别 男
 Sex
 出生日期 1978-06-07
 Date of birth
 工作单位 大信会计师事务所有限公司湖北分所
 Working unit
 身份证号码 420106197806072411
 Identity card No.



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after
 this renewal.



证书编号：
 No. of Certificate 42000320472

批准注册协会：
 Authorized Institute of CPA 湖北省注册会

发证日期：2007
 Date of Issuance





姓 名 郭略
 Full name 郭略
 性 别 女
 Sex 女
 出生日期 1982-09-26
 Date of birth 1982-09-26
 工作单位 大信会计师事务所湖北分所
 Working unit 大信会计师事务所湖北分所
 身份证号码 421022198209263420
 Identity card No. 421022198209263420



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after
 this renewal.



证书编号: 110100690058
 No. of Certificate

批准注册协会: 湖北省注册会计师协会
 Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2010 年 6 月 13 日
 Date of Issuance





天风证券股份有限公司
客户资产管理业务审核报告
大信专审字[2016]第 2-0100 号

大信会计师事务所（特殊普通合伙）
WUYIGE CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS LLP.







大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

客户资产管理业务审核报告

大信专审字[2016]第 2-00100 号

天风证券股份有限公司：

我们接受委托，对天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）2015年度所从事的客户资产管理业务进行了审核。

一、管理层的责任

按照中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于修改〈证券公司客户资产管理业务管理办法〉的决定》（中国证监会令第93号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]29号）、《证券公司定向资产管理业务实施细则》（中国证监会公告[2012]30号）（以下简称“客户资产管理业务监管要求”）的规定从事客户资产管理业务、编制和公允列报客户资产管理业务监管报表是贵公司管理层的责任。

二、注册会计师的责任

我们的责任是对贵公司是否按照客户资产管理业务监管要求的规定从事客户资产管理业务发表审计意见。我们的审计是按照《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》进行的。在审计过程中，我们结合贵公司的实际情况，实施了检查、重新计算等必要的审计程序。我们相信，我们获取的证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，贵公司客户资产管理业务在所有重大方面符合客户资产管理业务监管要求的



大信会计师事务所
北京市海淀区知春路1号
学院国际大厦15层
邮编 100083

WUYIGE Certified Public Accountants.LLP
15/F,Xueyuan International Tower
1 Zhichun Road,Haidian Dist
Beijing,China,100083

电话 Telephone: +86 (10) 82330558
传真 Fax: +86 (10) 82327668
网址 Internet: www.daxincpa.com.cn

规定，公允反映了贵公司2015年度客户资产管理业务的运营情况。

四、报告分发和使用限制的说明

本审计报告仅供贵公司管理当局参考及上报中国证券监督管理委员会使用，不得用于其他目的。因使用不当造成的后果，与执行本审计业务的会计师事务所及注册会计师无关。

附件：客户资产管理业务情况汇总表

大信会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：

中国注册会计师：

二〇一六年二月二十四日

客户资产管理业务情况汇总表

项目名称	户数	期末成本	期末市值	浮动 盈亏	已实现 未结算盈亏	备注
一、风险与收益不由证券公司承担						
受托资产：						
单一客户、定向资产管理业务	100.00	35,972,125,182.32	36,057,007,741.28			
其中：机构客户	90.00	35,322,925,182.32	35,428,295,465.70			
个人客户	10.00	649,200,000.00	628,712,275.58			
集合资产管理业务	3,670.00	20,974,471,246.12	21,438,103,059.57			
其中：机构客户	93.00	18,208,518,570.31	18,513,365,382.13			
个人客户	3,573.00	2,742,492,764.42	2,901,414,633.78			
自有资金投资	4.00	23,459,911.39	23,323,043.66			
专项资产管理业务	-	-	-			
小计	3,770.00	56,946,596,428.44	57,495,110,800.85			
受托资金：	金额： 56,946,596,428.44					
二、风险与收益由证券公司承担						
受托资产：						
单一客户、定向资产管理业务	-	-	-			
其中：机构客户	-	-	-			
个人客户	-	-	-			
集合资产管理业务	3,311.00	4,088,295,603.72	4,293,993,868.43			
其中：机构客户	12.00	2,808,011,565.00	2,883,815,287.36			
个人客户	3,287.00	636,208,631.75	647,476,732.79			
自有资金投资	12.00	644,075,406.97	762,701,848.28			
专项资产管理业务	-	-	-			
小计	3,311.00	4,088,295,603.72	4,293,993,868.43			
受托资金：	金额： 4,088,295,603.72					
三、受托资金总计	金额： 61,034,892,032.16					







营业执照

(副本)(6-1)

统一社会信用代码 91110108590611484C

名称 大信会计师事务所（特殊普通合伙）

类型 特殊普通合伙企业

主要经营场所 北京市海淀区知春路1号学院国际大厦1504室

执行事务合伙人 胡咏华, 吴卫星

成立日期 2012年03月06日

合伙期限 2012年03月06日至 2112年03月05日

经营范围 审查企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度财务决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；法律法规规定的其他业务。
（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）



在线扫码获取详细信息

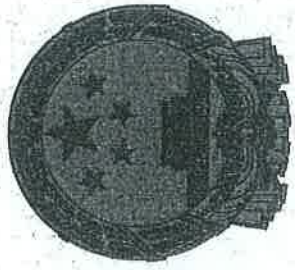
登记机关



2016年01月05日

提示：每年1月1日至6月30日通过企业信用信息公示系统报送上一年度年度报告并公示。





证书序号: NO. 019736

说明

1. 《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批, 准予执行注册会计师法定业务的凭证。
2. 《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的, 应当向财政部门申请换发。
3. 《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
4. 会计师事务所终止, 应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。

会计师事务所 执业证书

名称: 大信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 胡咏华

办公场所: 北京市海淀区知春路一号学院国际大厦15层

组织形式: 特殊普通合伙

会计师事务所编号: 11010141

注册资本(出资额): 3130万元

批准设立文号: 京财会许可[2011]0073号

批准设立日期: 2011-09-09



中华人民共和国财政部制



证书序号: 000418

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准

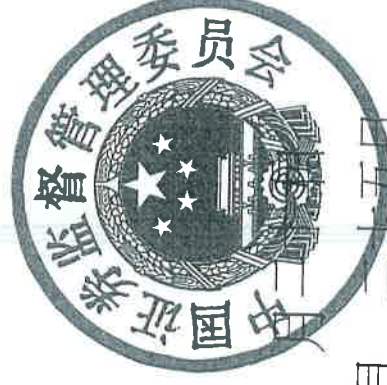
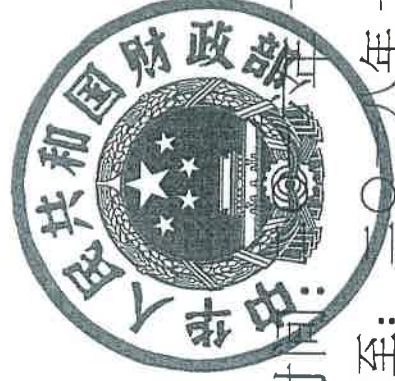
大信会计师事务所 (特殊普通合伙)

执行证券、期货相关业务。

首席合伙人: 胡咏华

证书号: 08

发证时间: 二〇〇八年一月二十五日
证书有效期至:





姓名 向辉
 Full name 向辉
 性别 男
 Sex 男
 出生日期 1978-06-07
 Date of birth 1978-06-07
 工作单位 大信会计师事务所有限公司
 Working unit 大信会计师事务所湖北分所
 身份证号码 420106197806072411
 Identity card No. 420106197806072411



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after this renewal.

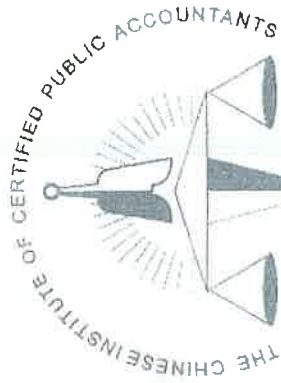


证书编号：
 No of Certificate 42000320472

批准注册协会：
 Authorized Institute of CPA 湖北省注册会

发证日期：2007 年 3 月 30 日
 Date of Issuance 2007 年 3 月 30 日





中国注册会计师协会

姓 名 郭 晗
 Full name 郭 晗
 性 别 女
 Sex
 出 生 日 期 1982-09-26
 Date of birth
 工 作 单 位 大信会计师事务所湖北分所
 Working unit
 身 份 证 号 码 421022198209263420
 Identity card No.



年度检验登记
 Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年
 This certificate is valid for another year after
 this renewal.



证书编号: 110100690058
 No. of Certificate

批准注册协会: 湖北省注册会计师协会
 Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2010 年 6 月 13 日
 Date of Issuance



