（上接B127版）

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

③独立的风险管理机构

公司风险监管总部、合规管理总部与监察稽核总部作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。

风险监管总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，对业务经营中的风险因素及风险事项进行评估和监测，对重要风险点设置控制参数和实施控制程序，对业务领域的风险状况进行统计、分析、评估和报告，并且对业务部门的风险管理状况进行考评。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对各业务领域、部门和主要岗位的内部控制制度执行情况履行管理、检查、反馈和督导等职责。

④业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门的负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

（2）风险管理制度体系

①全方位的风险管理机制

为推动公司风险管理体系的有效运作，确保公司各项业务经营活动在合规运作及风险可测、可控、可承受的前提下开展，公司制定并实施了涵盖各项业务运营和管理的一整套规章制度，明确了风险管理的目标、原则、组织体系、授权体系、相关职责、基本程序等，并通过事前审核、事中监控、事后检查的一系列执行机制，实现了对公司各项业务的合法性、合规性、风险程度的全方位和系统化的监控、预警、报告和处理。

②压力测试机制

公司根据《证券公司压力测试指引》，制订了《风险监管总部风险控制指标压力测试、模拟测算与敏感性分析实施细则（试行）》，建立压力测试机制，对压力测试触发情景、压力测试频率、压力测试方案确定、压力测试数据收集方法、压力测试结果分析与反馈、压力测试相关资料的保存与管理均进行了规范，有效保证了公司压力测试工作的规范性与有效性。

③专业人才

风险监管总部配备了熟悉证券业务与风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持。风险监管总部对经纪及财富管理、投资银行、固定收益、自营投资、资产管理、融资融券等业务进行实时监控和风险预警，对创新业务进行风险评估，对风险事项提出处理意见，并且督导落实。

④系统建设

为了全面评估公司风险状况，量化公司风险指标，公司通过考察市场同类系统及综合公司的风险管理需求，引入RM风险计量引擎建立公司市场风险管理信息系统，同时通过开发商进行数据库整合及界面视觉设计，并且配备相应系统建设、量化风险管理专业人员。2016年，公司完成市场风险管理信息系统一期的建设并投入使用，2017年将完成系统二期的建设，进一步提高精细化风险管理水平。

（3）风险管理指标体系

为确保公司以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标满足监管标准，有效控制风险，公司根据2016年新修订的《证券公司风险控制指标管理办法》，成立了由首席风险官任组长的跨部门风险控制指标工作小组，全面负责风控指标的管理。

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，并按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等。

6、公司面临的风险因素及对策

（1）市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：经纪业务面临证券价格或交易量的波动造成交易佣金及手续费收入减少的风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；固定收益业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的商品价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司遵循"董事会－投资决策相关委员会－自营业务部门"三级业务决策原则，制定市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、资产负债委员会、风险控制委员会、风险监管总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司经营管理层制定公司所能承担的最大市场风险敞口。该风险敞口的衡量和监察是根据投资规模及止损额度而制定，并规定整体的市场风险均控制在管理层已制定的范围内。

风险监管总部负责公司市场风险管理制度的具体落实，制定市场风险控制框架，对市场风险进行集中监管、报告，向经营层报告公司的总体市场风险情况，同时对业务部门所承担的所有市场风险进行监控；制定《市场风险管理办法》，建立健全了包括风险价值（VaR）在内的以各类风险指标为核心的量化指标体系，并对风险限额进行管理和监控，同时及时鉴别新产品及活动的市场风险，对各类定价模型和市场风险模型进行有效性验证，再结合情景分析、敏感性分析等手段，以确保持续、快速、有效地对市场风险识别、评估、测量和管理。

业务部门作为风险管理体系的第一层次，对所在部门的经营风险承担具体责任，并具体负责本部门风控制度的落实、日常检查和督促工作。

（2）信用风险

信用风险一般是指因客户、交易对手或证券发行人未履行合约责任而引致损失的风险。

公司的信用风险主要集中在以下业务：

①具有债权性质的债券等交易业务；

②融资融券业务、约定购回和股票质押式回购等有证券抵押的资本中介业务；

③场外衍生品业务；

④存放银行的活期存款及定期存款；

⑤其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对具有债权性质的债券等交易业务发行人违约的信用风险，公司对发行人进行风险评估，通过定性与定量相结合的方法衡量信用风险；对发行人及担保人设定投资等级准入标准和交易额度限制；发行人信用评估考虑因素包括发行主体信用评级、担保人信用评级、债券评级、市场情况等；持续监控投资发行人资信状况；明确违约司法追索程序。

针对资本中介业务和衍生品交易业务中，交易对手于约定日期未履行交割或支付义务的信用风险，公司对交易对手进行信用评估，选择信用等级良好的对手方进行交易，并根据交易对手资信状况进行授信；收受和追缴担保品，通过交易信用衍生产品对冲风险；严密监控交易的履约保障比例，及时通知交易对手追保、平仓，控制信用风险敞口；明确交易对手违约时司法追索程序。

报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为265.51%；约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为2,213.10%；股权质押回购交易负债客户平均维持担保比例为263.59%；股票收益互换负债客户平均维持担保比例为469%。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中登公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

（3）操作风险

操作风险是基础性风险，对于其他类别风险（如信用风险、市场风险等）有重要影响，操作风险是主要由不完善或有缺陷的内部程序、员工、信息技术系统及外部事件所造成损失的风险，操作风险管理不善，将会引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。报告期内，公司的操作风险主要集中在分支机构的内控管理、员工操作环节、业务系统应对新业务不够及时等方面，出现的风险已得到了较好的控制。

公司现已采取以下措施防范操作风险：一是建立完善的操作风险管理组织架构，董事会、公司风险控制委员会、风险管理总部、各业务部门（包括公司业务部门、分支机构、子公司），各司其职。二是建立一系列配套的操作风险管理制度，对业务流程风险环节、业务关键风险指标进行监控，对风险业务进行评估监测，定期分析风险事件发生的原因、全面审视各项业务。三是建立操作风险监控与报告机制，风险监管总部全面收集涵盖公司各部门的操作风险信息，每季度向风险控制委员会报告操作风险资本计量结果、操作风险损失事件、操作风险管理情况；确保风险报告渠道畅通，重大风险事项发生后能够及时向经营层报告并迅速应对。四是各部门分别制定《重大突发事件应急预案》并定期演练，合力将操作风险控制在合理范围内。

（4）流动性风险

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。如果未来经营环境出现急剧变化或财务管理不善，公司可能出现流动性不足，从而对经营和财务状况产生不利影响。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于：（1）公司资产或负债的集中度上升；（2）市场利率或融资成本大幅上行；（3）融资渠道受阻；（4）创新业务和各类交易对流动性的需求增加，如资本中介业务中由于业务需要而占用公司资金；（5）来自其他风险因素的传导，如信用评级下调或重大声誉事件等。

2016年，公司继续完善流动性风险日常管理，加强对流动性风险的动态监测与监控，具体应对措施包括但不限于：（1）通过合理的资产配置、多元化的负债融资和动态的资产负债表管理，保持适度流动性；（2）建立优质流动性资产组合计划，并按照审慎原则确定其规模和构成，储备了一定规模在极端情况下仍可随时变现的高流动性资产；（3）持续拓展融资渠道和交易对手，灵活运用各类债务融资工具，选择适当融资方式，把握好融资节奏；（4）加强日间流动性管理，合理安排短期融资事宜，储备并拓宽法人账户透支等日间融资渠道，确保具有充足的日间流动性头寸；（5）动态监测融资的结构和稳定程度，分析其对流动性风险的影响，并结合公司流动性缺口分布，适时调整融资策略，持续优化融资结构。

（五）动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

1、公司动态的风险控制指标监控机制建立情况

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，及时向监管部门报告风险指标变动及超预警、超标情况；按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等；对新开展业务及时纳入风控系统，如发生监管标准新政策，及时更新相关报表格式及阀值设置，对实时监控系统的有效性、准确性进行校对及维护。

2、风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

为做好事前业务规模风险控制，保证公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在安全标准之内，公司建立了多种场景的压力测试方法，涵盖多项业务及投资决策。2016年共进行1次综合压力测试、2次统一情景压力测试，6次业务规模敏感性分析，为公司进行资金分配、确定业务规模提供决策支持。

3、资本补足机制

公司按照中国证监会发布的《关于鼓励证券公司进一步补充资本的通知》和中证协发布的《证券公司资本补充指引》制定了三年资本补足规划（2015-2017），确定了资本补充触发机制。目前，公司正积极按照制定的资本补足规划，运用配股等方式筹集资本；同时，有计划地推动公司债务发行，积极研究创新债务融资工具，丰富融资方式，以支持业务创新发展并确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。

4、报告期内风险控制指标达标情况

2016年，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标整体运行良好。报告期末，母公司净资产为474.59亿元，较上年末减少7.62亿元；净资本为463.68亿元，较上年末减少19.21亿元；各项风险资本准备之和为185.42亿元，较上年末增加55.83亿元，主要是报告期内公司的分类评级下调，风险资本准备计提比例提高所致。风险覆盖率为250.07%，较上年末减少122.54个百分点；资本杠杆率为27.03%，较上年末增加4.30个百分点；流动性覆盖率为241.20%，较上年末减少624.26个百分点；净稳定资金率为123.08%，较上年末减少32.15个百分点。公司各项风险控制指标均符合监管要求，大部分处于较高的安全水平。

二、报告期内主营业务是否存在重大变化

报告期内，公司主营业务不存在重大变化。

三、占公司主营业务收入或主营业务利润10%以上的产品情况

不适用。

四、是否存在需要特别关注的经营季节性或周期性特征

不适用。

五、报告期内营业收入、营业成本、归属于上市公司普通股股东的净利润总额或者构成较前一报告期发生重大变化的说明

2016年，证券市场行情震荡盘整，年末上证综指与深证成指分别较年初下跌12.31%和19.64%，全年市场交易量较2015年有较大萎缩，同比下降48.76%。受此市场环境影响，2016年公司经纪及财富管理、投资与交易、资本中介等主要业务收入同比下降。2016年公司实现营业收入127.49亿元，较上年同期下降56.25%；实现归属于上市公司股东的净利润45.56亿元，较上年同期下降67.34%。

六、面临暂停上市和终止上市情况

不适用。

七、涉及财务报告的相关事项

（一）与上年度财务报告相比，会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况说明

报告期内，公司无会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况。

（二）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，公司无重大会计差错更正需追溯重述的情况。

（三）与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明

1、报告期内合并范围增加情况

（1）新设子公司

2016年4月，子公司深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司和广州支点创业投资有限公司共同出资设立深圳市国信运通基金管理有限公司，深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司对其实施控制。

2016年4月，子公司深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司和深圳市雅诺信珠宝首饰有限公司共同出资设立深圳市国信水贝珠宝基金管理有限公司，深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司对其实施控制。

2016年6月，子公司深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司和深圳云港股权基金管理有限公司共同出资设立国信弘盛能源基金管理（珠海）有限公司，深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司对其实施控制。

2016年8月，子公司深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司和江苏省文化投资管理集团有限公司共同出资设立华文弘盛基金管理（珠海）有限公司，深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司对其实施控制。

（2）纳入合并范围的结构化主体变动情况

报告期内，公司新增5个结构化主体纳入合并报表范围；3个结构化主体已清算，不再纳入合并报表范围。详见公司2016年度财务报表附注"九、在其他主体中的权益"。

2、报告期内合并范围减少情况

子公司深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）于2016年3月吸收其他合伙人，国信弘盛丧失控制权，2016年度合并范围因此减少。

子公司GS Investment Management Co Limited、深圳国信电子商务有限公司于2016年度注销，2016年度合并范围因此减少。

（四）对2017年1-3月经营业绩的预计

不适用。

国信证券股份有限公司

法定代表人：何如

董事会批准报送日期：2017年4月17日

股票简称：国信证券　　证券代码：002736　　编号：2017-016

国信证券股份有限公司
第三届董事会第四十次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

国信证券股份有限公司（以下简称"公司"）于2017年3月31日发出第三届董事会第四十次会议书面通知，于2017年4月13日发出补充通知。会议于2017年4月17日在深圳以现场和电话结合方式召开，应出席董事9名，实际出席董事9名，部分监事及高级管理人员列席了会议。何如董事长主持会议。本次会议的召开符合《公司法》等相关法律法规和《公司章程》的规定。

一、董事会审议通过并同意将以下报告或议案提交2016年度股东大会审议：

1、《2016年度财务决算报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

2、《2016年度利润分配方案》

经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司2016年度实现净利润5,331,379,557.06元（母公司）。根据《公司法》、《证券法》、《金融企业财务规则》及公司章程等有关规定，分别：

（1）提取10%的法定盈余公积金、10%的一般风险准备金和10%的交易风险准备金共计1,599,413,867.13元；

（2）计提永续次级债券利息290,412,456.03元；

（3）根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，按照公募基金托管费收入的2.5%提取一般风险准备金181,119.32元。

进行上述利润分配事项后，本年度实现可供投资者分配的利润为3,441,372,114.58元。

加上以前年度结余未分配利润15,987,244,945.10元，扣除公司2016年已实施的2015年度利润分配方案分配的股利4,920,000,000元，本年度累计可供投资者分配的利润为14,508,617,059.68元。根据相关规定，可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得向股东进行现金分配，因2016年公司可供分配利润中公允价值变动损益为负，因此，公司2016年末可供投资者现金分红部分为14,508,617,059.68元。

根据相关法律法规和《公司章程》的规定，从公司发展和股东利益等综合因素考虑，公司2016年度利润分配方案如下：以2016年末总股本8,200,000,000股为基数，向全体股东每10股派送现金红利2元（含税），共派送现金红利1,640,000,000元，尚未分配的利润12,868,617,059.68元转入下一年度。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

3、《2016年度高级管理人员履职情况和薪酬情况专项说明》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

4、《2016年度独立董事工作报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度独立董事工作报告》与本决议同日公告。

5、《2016年度董事会工作报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

6、《2016年度董事履职考核和薪酬情况专项说明》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

7、《2016年年度报告》及《2016年年度报告摘要》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年年度报告》及其摘要与本决议同日公告。

8、《关于2016年度关联交易及预计2017年度日常关联交易的议案》

（1）在审议公司与深圳市投资控股有限公司及其控制的其他企业的关联交易时，关联董事何如、王勇健、李新建回避表决，本议项的表决结果为：六票赞成、零票反对、零票弃权；

（2）在审议公司与华润深国投信托有限公司之间的关联交易时，关联董事孟扬回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权；

（3）在审议公司与云南红塔集团有限公司及股东变更后存续的云南合和（集团）股份有限公司之间的关联交易时，关联董事李双友回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权；

（4）在审议公司与鹏华基金管理有限公司之间的关联交易时，关联董事何如回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权；

（5）在审议公司与其他关联方之间的关联交易时，关联董事何如先生、王勇健先生、李新建先生、孟扬女士、李双友先生、黄明先生、蒋岳祥先生、肖幼美女士、白涛女士回避表决，因非关联董事人数不足三人，本议项直接提交股东大会审议。

《国信证券股份有限公司2017年度日常关联交易预计公告》与本决议同日公告。

9、《关于聘请2017年度审计机构及其报酬的议案》

同意续聘瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为公司2017年度外部审计机构以及2017年度内部控制的审计机构，审计费用合计不超过人民币160万元。提请股东大会授权董事会在审计机构的审计范围、审计内容变更导致审计费用增加的情况下，由董事会酌情确定相关审计费用。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

10、《国信证券股份有限公司章程》及其附件《董事会议事规则》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司章程》及其附件《董事会议事规则》与本决议同日公告。

11、《关于确定2017年度自营投资额度的议案》

（1）公司2017年自营权益类证券及其衍生品投资规模最高不超过净资本的80%。

（2）公司2017年自营非权益类证券及其衍生品投资规模最高不超过净资本的400%。

（3）授权公司资产负债委员会根据市场环境变化和公司实际情况，在符合各项监管要求的前提下，在自营最高投资规模额度内，灵活配置资金规模以及投资方向。

上述自营投资额度不包括公司长期股权投资额度。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

12、《关于将公司2016年度配股决议有效期延长一年的议案》

2015年5月19日召开的公司2014年度股东大会审议通过了《关于公司2015年度配股方案的议案》，同意公司本次配股相关决议自公司股东大会审议通过之日起12个月内有效。2016年5月20日召开的公司2015年度股东大会审议通过了《关于将公司2015年度配股决议有效期延长一年的议案》，同意将公司本次配股决议有效期延长一年至2017年5月20日。鉴于该决议有效期即将届满，为了保证相关工作的顺利进行，同意将公司本次配股决议的有效期继续延长一年。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

13、《关于将授权董事会全权办理2016年度配股有关事宜的授权期限延长一年的议案》

2015年5月19日召开的公司2014年度股东大会审议通过了《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次配股有关事宜的议案》，同意授权董事会全权办理与本次配股有关的具体事宜，包括但不限于：

（1）依据国家法律、法规、规范性文件及证券监督管理机构的有关规定和股东大会决议，办理本次配股的申报事宜；

（2）在法律、法规、规范性文件和《公司章程》允许的范围内，按照证券监督管理机构的要求，结合公司的实际情况，制定和实施本次配股的具体方案，包括本次配股实施时间、配股比例和数量、配股价格、配售起止日期、实际募集资金规模等相关事宜；

（3）决定或聘请参与本次配股发行的保荐人（主承销商）等中介机构；

（4）签署、修改、补充、递交、呈报、执行与本次配股有关的一切协议和申请文件并办理相关的申请、报批、登记、备案等手续，签署与本次配股相关的以及与募集资金使用相关的重大合同和重要文件；

（5）在股东大会决议范围内根据市场情况变化和公司实际情况对募集资金的具体安排进行调整；

（6）在本次配股完成后根据配股实施结果，增加公司注册资本、修改《公司章程》相应条款及办理证券监督管理机构、工商行政管理机关的核准、登记、备案等相关手续；

（7）在本次配股完成后，办理本次配股在深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记、锁定和上市等相关事宜；

（8）如证券监督管理机构等有关部门对配股有新的政策、规定或者监管部门有其他具体要求，根据该等新的政策、规定或者具体要求，对本次配股方案作出相应调整（但有关法律法规及《公司章程》规定须由股东大会重新表决的事项除外）；

（9）若控股股东不履行认配股份的承诺，或者配股代销期限届满，原股东认购股份的数量未达到拟配售股份数量百分之七十的，授权董事会按照发行价并加算银行同期存款利息返还已经认购的股东；

（10）授权董事会在相关法律、法规及规范性文件允许的情况下，办理其他与本次配股有关的事宜。

上述第（6）（7）（9）项授权自公司股东大会批准之日起至相关事项存续期内持续有效，其他各项授权自公司股东大会批准之日起12个月内有效。

2016年5月20日召开的公司2015年度股东大会审议通过了《关于将授权董事会全权办理2015年度配股有关事宜的授权期限延长一年的议案》，同意将上述（6）（7）（9）项以外的授权期限延长一年至2017年5月20日。

鉴于授权期限即将届满，为了保证相关工作的顺利进行，同意将授权董事会全权办理本次配股有关事宜的授权期限继续延长一年。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

14、《关于购买董事、监事及高级管理人员责任保险的议案》

（1）同意公司为公司及公司担任董事、监事及高级管理人员职务的人员购买责任保险，投保金额不超过人民币2亿元，保费（含增值税）每年不超过人民币60万元。

（2）提请股东大会授权董事会并同意由董事会授权经营管理层在遵循相关法律法规及规范性文件及行业惯例的前提下，办理购买董监高责任保险的相关事宜（包括但不限于：选定保险公司；确定投保金额、保费金额及保险合同条款；按需选择及聘任保险经纪公司或其他中介机构；签署相关法律文件及处理与投保相关的其他事项等），以及在今后董监高责任保险合同期满时或之前办理与续保或者重新投保等相关事宜。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

二、董事会审议通过以下议案：

1、《2016年度经营工作报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

2、《关于2016年度战略重点工作暨风险控制情况考核评价的议案》

议案表决情况：在何如董事长回避表决的情况下，其余八票赞成、零票反对、零票弃权。

3、《关于确定2017年度战略重点工作目标的议案》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

4、《2016年度合规报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

5、《2016年度风险管理报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

6、《2016年度流动性风险管理报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

7、《2016年度内部审计工作报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

8、《2016年度内部控制自我评价报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度内部控制自我评价报告》与本决议同日公告。

9、《2016年度内部控制规则落实自查表》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度内部控制规则落实自查表》与本决议同日公告。

10、《2016年度社会责任报告》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度社会责任报告》与本决议同日公告。

11、《国信证券股份有限公司董事会专门委员会议事规则》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司董事会专门委员会议事规则》与本决议同日公告。

12、《国信证券股份有限公司子公司管理办法》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

13、《国信证券股份有限公司全面风险管理制度》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

14、《关于确定2017年度公司及子公司风险容忍度的议案》

确定2017年度公司及子公司的风险容忍度，具体如下：

（1）公司2017年风险容忍度方案：

市场风险目标：公司整体市场风险值（1年VaR）占公司净资本比例不超过24%。

信用风险目标：公司整体信用风险值（1年VaR）占公司净资本比例不超过2%。

流动性风险目标：流动性风险偏好与公司整体的风险偏好保持一致，与公司审慎、持续稳健经营的理念保持一致，公司应当确保流动性覆盖率、净稳定资金率符合监管要求，按期偿付所有债务并满足正常业务开展的资金需求和压力情景下公司持续经营的流动性需求。

操作风险目标：因操作风险导致的损失不超过2016年营业收入的2‰。

（2）国信证券（香港）金融控股有限公司2017年风险容忍度方案：

市场风险目标：整体市场风险值（1年VaR）占净资本比例不高于25%。

信用风险目标：整体信用风险值（1年VaR）占净资本比例不高于2%。

流动性风险目标：流动性风险偏好与香港公司整体的风险偏好保持一致，与公司审慎、持续稳健经营的理念保持一致，公司当确保流动资金（Liquid Capital）符合香港证监会《财政资源规则（FRR）》要求，按期偿付所有债务和利息，满足正常业务开展及保证公司最少一个月运营生存期的资金需求。

操作风险目标：因操作风险导致的损失不超过2016年营业收入的2‰。

（3）国信弘盛创业投资有限公司2017年风险容忍度方案：

市场风险目标：整体市场风险值（1年VaR）不超过2016年营业收入的26%。

信用风险目标：整体信用风险值（1年VaR）不超过2016年营业收入的2%。

流动性风险目标：流动性风险偏好与公司整体的风险偏好保持一致，与公司审慎、持续稳健经营的理念保持一致，公司应当确保正常业务开展的资金需求和压力情景下公司持续经营的流动性需求。

操作风险目标：因操作风险导致的损失不超过2016年营业收入的2‰。

（4）国信期货有限责任公司2017年风险容忍度方案

市场风险目标：整体市场风险值（1年VaR）占其净资本比例不高于2%。

信用风险目标：整体信用风险值（1年VaR）占其净资本比例不高于2%。

流动性风险目标：流动性风险偏好与公司整体的风险偏好保持一致，与公司审慎、持续稳健经营的理念保持一致，公司应当确保风险监管指标（流动资产与流动负债的比例不得低于100%）符合监管要求，按期偿付所有债务并满足正常业务开展的资金需求和压力情景下公司持续经营的流动性需求。

操作风险目标：因操作风险导致的损失不超过其2016年营业收入的3‰。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

15、《关于向商业银行申请2017年度综合授信额度的议案》

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

16、《关于提议召开2016年度股东大会的议案》

同意召集召开公司2016年度股东大会，审议以下事项：

（一）表决事项：1、2016年度财务决算报告；2、2016年度利润分配方案；3、2016年度董事会工作报告；4、2016年度监事会工作报告；5、2016年度报告及其摘要；6、关于2016年度关联交易及预计2017年度日常关联交易的议案；7、关于聘请2017年度审计机构及其报酬的议案；8、关于修订公司章程及其附件的议案；9、关于确定2017年度自营投资额度的议案；10、关于将公司2016年度配股决议有效期延长一年的议案；11、关于将授权董事会全权办理2016年度配股有关事宜的授权期限延长一年的议案；12、关于购买董事、监事及高级管理人员责任保险的议案；13、关于国信证券（香港）金融控股有限公司2017年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案。

（二）非表决事项：1、2016年度高级管理人员履职考核和薪酬情况专项说明；2、2016年度独立董事工作报告；3、2016年度董事履职考核和薪酬情况专项说明；4、2016年度监事履职考核和薪酬情况专项说明。

关于公司2016年度股东大会召开的具体时间和地点授权董事长决定。

议案表决情况：九票赞成、零票反对、零票弃权。

特此公告。

附件：国信证券股份有限公司章程及其附件修订条款对照表

国信证券股份有限公司董事会

2017年4月18日

国信证券股份有限公司章程修订条款对照表

（修改之处以黑体字标识）

原条款序号、内容	新条款序号、内容
第117条 董事会行使下列职权： …… （13）管理公司信息披露事项； （14）向股东大会提请聘请或更换为公司审计的会计师事务所； （15）听取公司总裁的工作汇报并检查总裁的工作； （16）拟定董事（含独立董事）、监事津贴的标准； （17）负责督促、检查和评价公司各项内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制的有效性负责； （18）法律、行政法规、部门规章、本章程或股东大会授予的其他职权。	第117条 董事会行使下列职权： …… （13）承担全面风险管理的最终责任，推进风险文化建设，审议批准公司全面风险管理的基本制度，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额，公司章程规定的其他风险管理职责； （14）管理公司信息披露事项； （15）向股东大会提请聘请或更换为公司审计的会计师事务所； （16）听取公司总裁的工作汇报并检查总裁的工作； （17）拟定董事（含独立董事）、监事津贴的标准； （18）负责督促、检查和评价公司各项内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制的有效性负责； （19）法律、行政法规、部门规章、本章程或股东大会授予的其他职权。
第137条 风险管理委员会的主要职责如下： …… （7）董事会授予的其他职责。	第137条 风险管理委员会的主要职责如下： …… （7）审议公司全面风险管理的基本制度； （8）建立与首席风险官的直接沟通机制； （9）董事会授予的其他职责。
第168条 监事会行使下列职权： …… （11）根据法律、法规或本章程规定应由监事会行使或股东大会授权监事会行使的其他职权。 监事会可以要求公司董事、高级管理人员及其他相关人员出席监事会会议，回答问题。	第168条 监事会行使下列职权： …… （11）承担全面风险管理的监督职责，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改； （12）根据法律、法规或本章程规定应由监事会行使或股东大会授权监事会行使的其他职权。 监事会可以要求公司董事、高级管理人员及其他相关人员出席监事会会议，回答问题。

国信证券股份有限公司董事会议事规则修订条款对照表

（修改之处以黑体字标识）

原条款序号、内容	新条款序号、内容
第4条 董事会对股东大会负责，依照法律、行政法规、《公司章程》及本规则的相关规定行使下列职权： …… （14）管理公司信息披露事项； （15）向股东大会提请聘请或更换为公司审计的会计师事务所； （16）听取公司总裁的工作汇报并检查总裁的工作； （17）拟定董事（含独立董事）、监事津贴的标准； （18）负责督促、检查和评价公司各项内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制的有效性负责； （19）法律、行政法规、部门规章、《公司章程》或股东大会授予的其他职权； 董事会行使上述职权的方式是通过召开董事会会议审议决定，形成董事会决议后方可实施。在不违反相关法律法规及公司章程规定的前提下，董事会有权授权适当的公司内部机构、部门或董事履行或协助履行上述部分职权。	第4条 董事会对股东大会负责，依照法律、行政法规、《公司章程》及本规则的相关规定行使下列职权： …… （14）承担全面风险管理的最终责任，推进风险文化建设，审议批准公司全面风险管理的基本制度，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额，公司章程规定的其他风险管理职责； （15）管理公司信息披露事项； （16）向股东大会提请聘请或更换为公司审计的会计师事务所； （17）听取公司总裁的工作汇报并检查总裁的工作； （18）拟定董事（含独立董事）、监事津贴的标准； （19）负责督促、检查和评价公司各项内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制的有效性负责； （20）法律、行政法规、部门规章、《公司章程》或股东大会授予的其他职权； 董事会行使上述职权的方式是通过召开董事会会议审议决定，形成董事会决议后方可实施。在不违反相关法律法规及公司章程规定的前提下，董事会有权授权适当的公司内部机构、部门或董事履行或协助履行上述部分职权。

股票简称：国信证券　　证券代码：002736　　编号：2017-017

国信证券股份有限公司
第三届监事会第十三次会议决议公告

本公司及监事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

国信证券股份有限公司（以下简称"公司"）于2017年3月31日发出第三届监事会第十三次会议通知。会议于2017年4月17日在深圳以现场和电话相结合方式召开，应出席监事3名，实际出席监事3名。监事会主席何诚颖主持本次会议。本次会议的召开符合《公司法》等相关法律法规和《公司章程》的规定。

监事会审议了会议通知所列明的议案，并通过决议如下：

一、审议通过《2016年度利润分配方案》

全体监事认为，公司2016年度利润分配方案符合《公司法》、《证券法》、中国证监会关于上市公司现金分红的有关规定以及《公司章程》、《国信证券股份有限公司股东分红回报规划》的规定，符合公司目前的实际经营状况，有利于公司的长期发展，不存在损害公司中小投资者利益的情形。

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《公司2016年度利润分配方案》尚需提交股东大会审议。

二、审议通过《2016年度合规报告》

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

三、审议通过《2016年度内部控制自我评价报告》

全体监事认为，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，2016年度公司不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷，未发现公司非财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。公司2016年度内部控制评价报告真实、客观、完整地反映了公司内部控制制度的执行情况和效果，符合公司内部控制的实际情况。

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度内部控制自我评价报告》与本决议同日公告。

四、审议通过《2016年度社会责任报告》

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年度社会责任报告》与本决议同日公告。

五、审议通过《2016年度监事会工作报告》

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《公司2016年度监事会工作报告》尚需提交股东大会审议。

六、审议通过《2016年度监事履职考核和薪酬情况专项说明》

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《公司2016年度监事履职考核和薪酬情况专项说明》尚需向股东大会报告。

七、审议通过《2016年年度报告》及其摘要，并就公司2016年度报告出具如下专项审核意见：

经审核，全体监事认为，公司董事会编制和审议公司2016年度报告的程序符合法律、行政法规和中国证监会的规定，报告内容真实、准确、完整地反映了公司的实际情况，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司2016年年度报告》及其摘要尚需提交股东大会审议。

《国信证券股份有限公司2016年年度报告》及其摘要与本决议同日公告。

八、审议通过《国信证券股份有限公司监事会议事规则》

议案表决情况：三票赞成、零票反对、零票弃权。

《国信证券股份有限公司监事会议事规则》尚需提交股东大会审议。

《国信证券股份有限公司监事会议事规则》与本决议同日公告。

特此公告。

附件：国信证券股份有限公司监事会议事规则修订条款对照表

国信证券股份有限公司监事会

2017年4月18日

附件：

国信证券股份有限公司监事会议事规则修订条款对照表

（修改之处以黑体字标识）

原条款序号、内容	新条款序号、内容
第2条 监事会向股东大会负责，依据法律、行政法规、《公司章程》及本规则的相关规定行使下列职权： …… （11）根据法律、行政法规或《公司章程》应由监事会行使或股东大会授权监事会行使的其他职权。 监事会可以要求公司董事、高级管理人员及其他相关人员出席监事会会议，回答问题。	第2条 监事会向股东大会负责，依照法律、行政法规、《公司章程》及本规则的相关规定行使下列职权： …… （11）承担全面风险管理的监督职责，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改； （12）根据法律、行政法规或《公司章程》应由监事会行使或股东大会授权监事会行使的其他职权。 监事会可以要求公司董事、高级管理人员及其他相关人员出席监事会会议，回答问题。

股票简称：国信证券　　证券代码：002736　　编号：2017-018

国信证券股份有限公司
2017年度日常关联交易预计公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、日常关联交易基本情况

（一）日常关联交易概述

根据《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》（以下简称"《上市规则》"）、《企业会计准则第36号——关联方披露》等有关法律、法规、规范性文件以及《国信证券股份有限公司章程》等公司制度的规定，基于重要性原则、参考同行业上市公司相关情况，国信证券股份有限公司（以下简称"公司"）对2016年度关联交易情况进行汇总，并结合公司日常经营和业务发展需要，对2017年度及至召开2017年度股东大会期间的日常关联交易进行预计。

本次日常关联交易预计事项需履行董事会及股东大会的审议程序。2017年4月17日，公司第三届董事会第四十次会议逐项审议通过《关于2016年度关联交易及预计2017年度日常关联交易的议案》，表决情况如下：

1、在审议公司与深圳市投资控股有限公司（以下简称"深投控"）及其直接或间接控制的除国信证券及其控股子公司之外的其他法人或其他组织（以下简称"深投控控制企业"）之间的关联交易时，关联董事何如、王勇健、李新建回避表决，本议项的表决结果为：六票赞成、零票反对、零票弃权。

2、在审议公司与华润深国投信托有限公司（以下简称"华润信托"）之间的关联交易时，关联董事孟扬回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权。

3、在审议公司与云南红塔集团有限公司（以下简称"云南红塔"）及股东变更后存续的云南合和（集团）股份有限公司（以下简称"云南合和"）之间的关联交易时，关联董事李双友回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权。

4、在审议公司与鹏华基金管理有限公司（以下简称"鹏华基金"）之间的关联交易时，关联董事何如回避表决，本议项的表决结果为：八票赞成、零票反对、零票弃权。

5、在审议公司与其他关联方之间的关联交易时，公司全体董事回避表决，因非关联董事人数不足三人，本议项直接提交股东大会审议。

该议案尚需提交公司股东大会审议。股东大会对本议案进行逐项表决时，深投控、华润信托等关联股东应回避相关议项的表决。

（二）预计日常关联交易类别和金额

关联交易类别	关联交易内容	具体交易说明	2017年度预计金额	2018年1-5月份预计金额	关联方	截至2017年一季度末已发生金额（万元）	上年发生金额（万元）
证券和金融产品服务	为关联方提供证券经纪、证券投资咨询、证券资产管理、证券承销与保荐、财务顾问、代销金融产品、资产托管、运营外包、基金管理等证券和金融产品服务，或接受关联方提供的上述证券和金融产品服务	为关联方提供证券代理买卖交易服务、期货经纪服务等产生的佣金收入、通过特定交易席位为关联方提供交易服务产生的席位收入	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，因此将参照市场水平定价，以实际发生额计算	同前	深投控及其控制企业	–	19.18
					华润信托	64.26	5,168.25
					云南合和	–	–
					鹏华基金	319.55	1,695.68
					其他关联方	183.23	954.55
		向关联方提供投资咨询服务产生的收入			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	–	0.23
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	–	–
		向关联方提供财务顾问服务产生的收入			深投控及其控制企业	200	–
					华润信托	142.83	1,036.07
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	419.39	45.07
		为关联方代销金融产品产生的收入			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	25.92	110.51
					云南合和	–	–
					鹏华基金	530.15	649.15
					其他关联方	28.77	160.43
		向关联方提供资产管理服务产生的收入			深投控及其控制企业	11.09	20.04
					华润信托	–	–
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	655.64	3,623.55
		向关联方提供证券承销与保荐服务产生的收入			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	–	–
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	–	326
		其他			公司全体关联方	–	–
小计			/	/		2,580.83	13,808.71
证券和金融产品交易	与关联方进行买入返售或卖出回购交易、与关联方进行股票、债券或衍生品销售交易、与关联方进行收益权转让交易、认购关联方发行或管理的金融产品、关联方认购公司发行或管理的金融产品等	与关联方进行买入返售交易产生的利息收入	由于证券市场情况无法预计，交易量难以估计，因此将参照市场水平定价，以实际发生额计算	同前	深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	–	–
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	–	8.93
		与关联方进行卖出回购交易产生的利息支出			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	8.56	20.71
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	11.48	77.05
		与关联方进行债券自营交易			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	–	–
					云南合和	–	–
					鹏华基金	–	–
					其他关联方	2,852.57	25,652.52
		认购关联方发行或管理的金融产品			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	–	–
					云南合和	–	–
					鹏华基金	65,774.21	143,197.31（2016年底持有产品金额）
					其他关联方	–	–
		关联方销售、分销公司承销的债券			深投控及其控制企业	–	–
					华润信托	10,000.00	77,300.00
					云南合和	–	–
					鹏华基金	5,000.00	270,500.00
					其他关联方	–	244,100.00
		其他			公司全体关联方	–	–
小计			/	/		83,646.82	760,856.53
房屋、通信管道租赁相关	承租关联方房屋或通信管道、或接受关联方物业管理服务等	承租关联方房屋、通信管道、及接受关联方物业管理服务产生的费用	预计不超过900万元（含本数）	预计不超过420万元（含本数）	深投控及其控制企业	201.43	652.6
			预计不超过900万元（含本数）	预计不超过420万元（含本数）	华润信托	208.13	858.68
小计			不超过1,800万元（含本数）	不超过840万元（含本数）		409.56	1,511.28
综合服务	关联方为公司提供会议和酒店服务、工程设计、环境监理等综合服务	接受关联方会议和酒店服务等产生的费用	由于会议和酒店服务等将取决于公司的实际需要，因此将参照市场水平定价，以实际发生额计算		深投控及其控制企业	12.5	42.07
		接受关联方工程设计服务产生的费用	预计不超过110万元（含本数）	预计不超过110万元（含本数）	深投控及其控制企业	–	–
		接受关联方环境监理服务产生的费用	预计不超过5万元（含本数）	预计不超过5万元（含本数）	深投控及其控制企业	–	–
小计			/			12.5	42.07
共同投资	与关联方共同投资	公司根据日常业务开展需要，与关联方共同发起设立、投资相关企业	将参照市场水平定价，因业务发生及规模的不确定性，以实际发生额计算	同前	公司全体关联方	–	–
小计			/			–	–

（三）上一年度日常关联交易实际发生情况

关联交易类别	关联交易内容	具体交易说明	关联方	实际发生金额（万元）	预计金额	实际发生额占同类业务的比例（%）	对公司利润的影响（万元）
证券和金融产品服务	为关联方提供证券经纪、证券投资咨询、证券资产管理、证券承销与保荐、财务顾问、代销金融产品、资产托管、运营外包、基金管理等证券和金融产品服务，或接受关联方提供的上述证券和金融产品服务	为关联方提供证券代理买卖交易服务、期货经纪服务等产生的佣金收入、通过特定交易席位为关联方提供交易服务产生的席位收入	深投控及其控制企业	19.18	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，因此参照市场水平定价，以实际发生额计算。	0	19.18
			华润信托	5,168.25		/	5,168.25
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	1,695.68		4.74	1,695.68
			其他关联方	954.55		/	954.55
		向关联方提供投资咨询服务产生的收入	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	0.23		0	0.23
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	–		–	–
		向关联方提供财务顾问服务产生的收入	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	1,036.07		13.33	1,036.07
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	45.07		0.11	45.07
		为关联方代销金融产品产生的收入	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	110.51		0.93	110.51
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	649.15		5.48	649.15
			其他关联方	160.43		1.36	160.43
		向关联方提供基金资产管理服务产生的收入	深投控及其控制企业	20.04		0.17	20.04
			华润信托	–		–	–
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	3,623.55		95.18	3,623.55
		向关联方提供证券承销与保荐服务产生的收入	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	–		–	–
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	326		0.31	326
		其他	公司全体关联方	–		–	–
	小计			13,808.71	/		13,808.71
证券和金融产品交易	与关联方进行买入返售或卖出回购交易、与关联方进行股票、债券或衍生品销售交易、与关联方进行收益权转让交易、认购关联方发行或管理的金融产品、关联方认购公司发行或管理的金融产品等	与关联方进行买入返售交易产生的利息收入	深投控及其控制企业	–	由于证券市场情况无法预计，交易量难以估计，因此参照市场水平定价，以实际发生额计算	–	–
			华润信托	–		–	–
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	8.93		0.01	8.93
		与关联方进行卖出回购交易产生的利息支出	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	20.71		0.04	–20.71
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	77.05		0.13	–77.05
		与关联方进行债券自营交易	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	–		–	–
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	–		–	–
			其他关联方	25,652.52		0.07	/
		认购关联方发行或管理的金融产品	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	–		–	–
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	143,197.32（2016年底持有产品金额）		36.83	1,561.75
			其他关联方	–		–	–
		关联方销售、分销公司承销的债券	深投控及其控制企业	–		–	–
			华润信托	77,300.00		0.6	/
			云南合和	–		–	–
			鹏华基金	270,500.00		2.1	/
			其他关联方	244,100.00		1.9	/
		其他	公司全体关联方	–		–	–
	小计			760,856.53	/	/	1,472.92
房屋、通信管道租赁相关	承租关联方房屋或通信管道、或接受关联方物业管理服务等	承租关联方房屋、通信管道、及接受关联方物业管理服务产生的费用	深投控及其控制企业	652.6	预计产生费用不超过1,000万元（含本数）	/	–652.6
			华润信托	858.68	预计产生费用不超过1,500万元（含本数）	5	–858.68
	小计			1,511.28	不超过2,500万元（含本数）	/	–1,511.28
综合服务	关联方为公司提供会议和酒店服务、工程设计、环境监理等综合服务	接受关联方会议和酒店服务等产生的费用	深投控及其控制企业	42.07	由于会议和酒店服务等将取决于公司的实际需要，因此将参照市场水平定价，以实际发生额计算	2.08	–42.07
		接受关联方工程设计服务产生的费用	深投控及其控制企业	–	预计期间内该项支出不超过500万元（含本数）	–	–
		接受关联方环境监理服务产生的费用	深投控及其控制企业		预计期间内该项支出不超过10万元（含本数）		
	小计			42.07	/	/	–42.07
共同投资	与关联方共同投资	公司根据日常业务开展需要，与关联方共同发起设立、投资相关企业	公司全体关联方	–	将参照市场水平定价，因业务发生及规模的不确定性，以实际发生额计算	–	–
	小计			–	/	–	–

二、关联人介绍和关联关系

（一）深圳市投资控股有限公司及其直接或间接控制的除国信证券及其控股子公司之外的其他法人或其他组织

深圳市投资控股有限公司目前持有公司33.53%的股份，为公司控股股东。该公司成立于2004年10月13日，住所为深圳市福田区深南路投资大厦18楼，注册资本（实收资本）215.80亿元，主营业务包括通过重组整合、资本运作和资产处置等手段，对全资、控股和参股企业的国有股权进行投资、运营和管理等，法定代表人为彭海斌，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会持有其100%的股权。

截至2016年12月31日，深投控总资产为38,378,826.00万元，净资产为17,476,031.00万元；2016年，深投控实现营业收入4,228,286.00万元，实现净利润1,120,827.00万元（以上数据未经审计）。

深投控及其直接或间接控制的除国信证券及其控股子公司之外的其他法人或其他组织符合《上市规则》第10.1.3第（一）项、第10.1.3第（二）项规定的关联关系情形。上述关联方依法存续且经营正常，财务状况较好，具备履约能力。

（二）华润深国投信托有限公司

华润深国投信托有限公司目前持有公司25.15%的股份。该公司成立于1982年8月24日，住所为深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座第10-12层，注册资本（实收资本）60亿元，主营业务为信托业务等，法定代表人为孟扬，华润股份有限公司持有其51%的股权，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会持有其49%的股权。

截至2016年12月31日，华润信托总资产为1,898,006.12万元，净资产为1,690,303.24万元；2016年，华润信托实现营业收入300,247.21万元，实现净利润193,883.53万元（以上数据未经审计）。

华润信托符合《上市规则》第10.1.3第（四）项规定的关联关系情形。华润信托依法存续且经营正常，财务状况较好，具备履约能力。

（三）云南红塔集团有限公司及股东变更后存续的云南合和（集团）股份有限公司

公司于2015年12月30日接到云南红塔集团有限公司书面通知，云南红塔唯一股东云南合和（集团）股份有限公司将以吸收合并方式合并云南红塔，合并后云南红塔将注销，云南红塔原债权、债务由云南合和承继，云南红塔所持有的公司16.77%的股份全部变更至云南合和名下。本次股东权益变动正在履行监管部门相应核准程序，该变更完成后，云南合和将持有公司1,374,763,407股股份，占公司总股本的比例为16.77%。

根据云南省工商行政管理局出具的《准予注销登记通知书》（（云）登记内注核字[2016]第9072号），云南红塔已于2016年5月26日被准予注销登记。

注销前的云南红塔符合《上市规则》第10.1.3第（四）项规定的关联关系情形。股东变更后存续的云南合和符合《上市规则》第10.1.6第（一）项规定的关联关系情形。云南合和依法存续且经营正常，财务状况较好，具备履约能力。

（四）鹏华基金管理有限公司

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日，住所为深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层，注册资本（实收资本）15,000万元，法定代表人为何如，主营业务包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司持有鹏华基金50%的股权，系公司的联营企业，且公司董事长何如先生担任该公司董事长。

截至2016年12月31日，鹏华基金总资产为314,730.26万元，净资产为176,227.29万元；2016年，鹏华基金实现营业收入196,831.06万元，实现净利润51,738.60万元（以上数据经审计）。

鹏华基金符合《上市规则》第10.1.3第（三）项规定的关联关系情形。鹏华基金依法存续且经营正常，财务状况较好，具备履约能力。

（五）其他关联方

除上述关联方外，公司的关联自然人、其他关联法人包括：

1、关联自然人

根据《上市规则》第10.1.5条的规定，上市公司的关联自然人包括：

（1）直接或者间接持有上市公司5%以上股份的自然人；（2）上市公司董事、监事及高级管理人员；（3）直接或者间接地控制上市公司的法人或者其他组织的董事、监事及高级管理人员；（4）上述第（1）项、第（2）项所述人士的关系密切的家庭成员，包括配偶、父母及配偶的父母、兄弟姐妹及其配偶、年满18周岁的子女及其配偶、配偶的兄弟姐妹和子女配偶的父母；（5）中国证监会、深圳证券交易所或者上市公司根据实质重于形式的原则认定的其他与上市公司有特殊关系，可能造成上市公司对其利益倾斜的自然人。

2、其他关联法人

根据《上市规则》第10.1.3的规定，公司的其他关联法人包括：

公司关联自然人直接或者间接控制的，或者担任董事、高级管理人员的，除公司及其控股子公司以外的法人或其他组织。

三、关联交易主要内容

（一）关联交易定价原则和依据

公司与各关联方之间发生的业务均严格遵循市场化的定价原则，公司主要业务具体定价依据如下：

1、证券经纪服务收入：参照市场上同类交易服务的佣金费率定价；

2、投资咨询服务收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

3、财务顾问服务收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

4、金融产品代销服务收入：参照产品发行方统一销售政策定价；

5、资产管理服务收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

6、承销保荐服务收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

7、资产托管服务收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

8、运营外包：参照市场价格水平及行业惯例定价；

9、回购交易：参照市场价格水平及行业惯例定价；

10、股票、债券或衍生品销售交易收入：参照市场价格水平及行业惯例定价；

11、收益权转让交易：参照市场价格水平及行业惯例定价；

12、认购金融产品：参照市场价格水平及行业标准认购相关金融产品并支付管理费；

13、共同投资：参照市场价格水平定价。

（二）关联交易协议签署情况

在年度日常关联交易预计范围内，关联交易实际发生时，公司将另行签订相关协议。关联交易发生超出预计范围的，公司将按照《上市规则》相关规定及时履行相应审批程序及信息披露义务。

四、关联交易目的和对上市公司的影响

1、公司拟进行的关联交易有助于公司在日常经营范围内的业务开展、增加盈利机会；

2、相关关联交易的定价均参考市场价格进行，交易价格公允，不存在损害公司及中小股东利益的情形；

3、相关关联交易不会对公司的独立性造成影响，公司主要业务未因此类交易而对关联方形成依赖。

五、独立董事事前认可情况和发表的独立意见

公司独立董事对公司2016年度实际发生的日常关联交易及2017年度预计情况进行了事前认可，并发表独立意见如下：

1、公司2016年度实际发生的日常关联交易均在预计范围内，交易价格公允，不存在损害公司及中小股东合法权益的情形，也不会影响公司的独立性。

2、公司对2017年将发生的日常关联交易的预计合理，相关业务的开展符合公司实际业务需要，有利于公司的长远发展。

3、有关的关联交易情况应根据《上市规则》在公司年度报告和中期报告中予以披露。

六、备查文件

1、公司第三届董事会第四十次会议决议公告

2、公司独立董事关于2016年度关联交易及预计2017年度日常关联交易的事前认可意见及独立意见

特此公告。

国信证券股份有限公司董事会

2017年4月18日