

国海证券股份有限公司

2016年度风险控制指标情况报告

2016年，国海证券股份有限公司（以下简称公司）切实贯彻监管要求，动态监控净资本等风险控制指标，全面开展敏感性分析和压力测试，确保风险控制指标持续达到监管部门规定的标准。

一、报告期内风险控制指标的具体情况和达标情况

（一）报告期内，公司风险控制指标具体情况如下：

项目	2016年12月31日 (经审计)	2015年12月31日 (经审计)
核心净资本(元)	11,357,466,277.90	10,848,996,748.61
附属净资本(元)	1,999,944,235.40	3,799,848,096.78
净资本(元)	13,357,410,513.30	14,648,844,845.39
净资产(元)	13,486,631,087.03	12,880,783,879.86
各项风险资本准备之和(元)	5,363,051,129.08	3,280,665,090.94
表内外资产总额(元)	53,537,834,329.16	34,089,074,613.01
风险覆盖率	249.06%	446.52%
资本杠杆率	21.21%	31.83%
流动性覆盖率	226.32%	270.57%
净稳定资金率	144.65%	202.28%
净资本/净资产	99.04%	113.73%
净资本/负债	33.58%	69.47%

净资产/负债	33.91%	61.08%
自营权益类证券及 衍生品/净资本	1.94%	20.89%
自营非权益类证券及 其衍生品/净资本	238.40%	84.97%

（二）报告期内，公司风险控制指标达标情况

在报告期内，“持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例”存在超过监管预警标准和监管标准的情况，该情况发生在《证券公司风险控制指标管理办法》规定的过渡期内，各部门已制定措施确保该项指标在过渡期内完成整改，现已符合监管规定要求。

张杨等人伪造公司印章私签债券交易协议事件导致“持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例”超过监管预警标准和监管标准的情况，已按规定向监管部门报告。

其余各项风险控制指标均持续符合监管规定，未发生触及监管预警标准及监管标准的情况。

二、风险控制指标动态监控情况

根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司风险控制指标动态监控系统指引（试行）》的要求，报告期内，公司利用风险控制指标动态监控系统实现风险控制指标计量、动态监控和及时预警的管理目标。公司风险控制指标动态监控机制，能

够及时监控以净资本和流动性为核心的风险控制指标和流动性风险控制指标的变动情况，并根据变化情况采取有效措施，以确保各项风险控制指标持续符合监管要求。

报告期内，公司按照规定开展敏感性分析和压力测试工作，确保了风险可测、可控、可承受，保障可持续经营。

三、净资本补足机制建立情况

公司建立了净资本补足机制，当公司净资本等风险控制指标达到预警标准时，公司将采用压缩风险性较高的投资经营品种或规模、追讨往来账项、转让长期股权投资、处置有形或无形资产、减少或暂停利润分配、发行次级债等方式补充净资本，以确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管部门的要求。

国海证券股份有限公司
二〇一七年三月二十四日