

国元证券股份有限公司 第八届董事会第七次会议决议公告

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

一、董事会会议召开情况

国元证券股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）第八届董事会第七次会议通知于 2017 年 6 月 13 日以专人送达或电子邮件方式发出，会议于 2017 年 6 月 16 日以通讯方式召开。本次会议应表决的董事 11 人，实际表决的董事 11 人。会议的召开符合《公司法》及《公司章程》等有关规定。

二、董事会会议审议情况

（一）审议通过《关于在深圳福田区新设一家证券营业部的议案》。

根据中国证监会《证券公司分支机构监管规定》（〔2013〕17 号公告）要求以及公司经纪业务发展需要，同意公司在深圳市福田区设立 1 家证券营业部，并授权公司经营管理层办理新设分支机构的申请等相关手续和具体事宜。

新设证券营业部经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；证券投资基金代销；融资融券业务；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问业务；代销金融产品；证券资产管理（仅限项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作）；证券承销与保荐（项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作）。具体经营范围以监管部门的核定为准。

表决结果：赞成票【11】票，反对票【0】票，弃权票【0】票，审议通过本议案。

（二）审议通过《关于在广州经济技术开发区新设一家证券营业部的议案》。

根据中国证监会《证券公司分支机构监管规定》（〔2013〕17 号公告）要求

以及公司经纪业务发展需要，同意公司在广东省广州市经济技术开发区设立 1 家证券营业部，并授权公司经营管理层办理新设分支机构的申请等相关手续和具体事宜。

新设证券营业部经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；证券投资基金代销；融资融券业务；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问业务；代销金融产品；证券资产管理（仅限项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作）；证券承销与保荐（项目承揽、项目信息传递与推荐、客户关系维护等辅助工作）。具体经营范围以监管部门的核定为准。

表决结果：赞成票【11】票，反对票【0】票，弃权票【0】票，审议通过本议案。

（三）审议通过《关于修订〈国元证券股份有限公司全面风险管理制度〉的议案》。

根据中国证券业协会发布新修订的《证券公司全面风险管理规范》要求，同意公司修订的《国元证券股份有限公司全面风险管理制度》。

表决结果：赞成票【11】票，反对票【0】票，弃权票【0】票，审议通过本议案。

《国元证券股份有限公司全面风险管理制度》修订内容如下：

原文	修订稿
第一条 为促进公司规范经营，加强公司全面风险管理，保障公司各项业务持续、稳定、健康发展，依据《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司全面风险管理规范》、《上市公司内部控制工作指引》等法律、法规和准则，结合公司实际情况，特制定本制度。	第一条 为促进公司规范经营，加强公司全面风险管理，保障公司各项业务持续、稳定、健康发展，依据《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司全面风险管理规范》等法律、法规和准则，结合公司实际情况，特制定本制度。
第二条 本制度所称全面风险管理，是指公司董事会、经理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用	第二条 本制度所称全面风险管理，是指公司董事会、经理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用

风险、操作风险、信息技术风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。	风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。
第三条 公司全面风险管理的目标是：促进公司业务经营持续健康发展，确保公司各项业务在可承受的风险范围内有序运作；保障公司资产和客户受托资产的安全完整；公司经营中整体风险可测、可控、可承受，最终实现公司的经营战略和发展目标。	第三条 公司全面风险管理的目标是：促进公司业务经营持续健康发展，确保公司各项业务在可承受的风险范围内有序运作；保障公司资产和客户受托资产的安全完整；公司经营中整体风险可测、可控、可承受，最终实现公司的经营战略和发展目标。
第四条 公司全面风险管理工作遵循以下原则： （一）全面性原则。公司风险管理应当覆盖公司经营所面临的所有风险类别，以及公司的所有业务、机构和人员，贯穿决策、执行、监督和反馈的全过程。 （二）制衡性原则。公司风险管理应当通过制度、流程、系统管理等方式，实现不同业务环节的相互制约，以及前、中、后台相关部门、相关岗位之间的相互制衡与监督。履行风险管理职责的部门应独立于监管对象，客观独立地履行风险管理各项职责。 （三）针对性原则。公司应对各风险进行等级划分，对不同等级风险采取不同的资源投入和风险应对措施。重点加强对高等级风险、内控薄弱环节和新业务风险的识别、监测和管控。 （四）适应性原则。公司风险管理应当与公司的经营规模、风险状况、承受能力和创新发展要求等相匹配，符合监管及行业自律要	第四条 公司全面风险管理工作遵循以下原则： （一）全面性原则。公司风险管理应当覆盖公司经营所面临的所有风险类别，以及公司的所有业务、机构和人员，贯穿决策、执行、监督和反馈的全过程。 （二）制衡性原则。公司风险管理应当通过制度、流程、系统管理等方式，实现不同业务环节的相互制约，以及前、中、后台相关部门、相关岗位之间的相互制衡与监督。履行风险管理职责的部门应独立于监管对象，客观独立地履行风险管理各项职责。 （三）针对性原则。公司应对各风险进行等级划分，对不同等级风险采取不同的资源投入和风险应对措施。重点加强对高等级风险、内控薄弱环节和新业务风险的识别、监测和管控。 （四）适应性原则。公司风险管理应当与公司的经营规模、风险状况、承受能力和创新发展要求等相匹配，符合监管及行业自律要

求，与行业发展实际水平相适应，以合理的成本和措施实现风险管理目标。	求，与行业发展实际水平相适应，以合理的成本和措施实现风险管理目标。
第五条 公司风险管理组织架构由四个层次构成，分别为：公司董事会及下设的风险管理委员会，经营管理层及下设的风控与合规委员会，包括风险监管部、合规管理部、稽核部、信息技术部、资金计划部、董事会办公室等在内的履行风险管理相关职能的部门，各业务部门及内设的风险管理岗位。	第五条 公司风险管理组织架构由四个层次构成，分别为：公司董事会及下设的风险管理委员会；经营管理层及下设的风控与合规委员会等非常设机构；包括风险监管部、发行审核部、合规管理部、稽核部、信息技术总部、资金计划部、董事会办公室等在内的履行风险管理相关职能的部门；各业务部门及内设的风险管理岗位。
第六条 公司董事会是风险管理的最高决策机构，负责确定风险偏好和风险管理原则，制定风险管理战略和风险管理政策，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。 董事会设立风险管理委员会，按照公司章程和《风险管理委员会工作细则》的规定履行职责和义务，主要负责研究制定公司总体风险控制和管理政策，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。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。	第六条 公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，履行以下职责： （一）推进风险文化建设； （二）审议批准公司全面风险管理的基本制度； （三）审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额； （四）审议公司定期风险评估报告； （五）任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇； （六）建立与首席风险官的直接沟通机制； （七）公司章程规定的其他风险管理职责。 董事会设立风险管理委员会，按照公司章程和董事会《风险管理委员会工作细则》的规定履行职责和义务。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。
	第七条 公司监事会承担全面风险管理的监督责任，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。
第七条 公司经营管理层设立风控与合规委员会,根据公司董事会批准的风险管理准则与风险管理制度履行职责和义务。负责根据董事会风险管理委员会核准的内部控制与风险管理政策,组织、协调和指导公司内部控制和风险管理各项决策的实施;审定经营管理的风险控制制度和流程;审定内部监督检查部门的工作报告及各项业务的风险控制报告;建立健全内部控制缺陷的纠正和处理机制,对重大风险或风险隐患和内控缺陷进行通报和分析,及时纠正内部控制存在的缺陷和问题;建立健全风险控制指标管理和净资本管理机制;审定公司年度综合压力测试方案和报告;审定其他与风险管理相关的事项。公司采取相关措施保障全面风险管理的有效性,董事长、总裁对公司全面风险管理的有效性承担主要责任。	第八条 公司经营管理层对全面风险管理承担主要责任,履行以下职责: (一)制定风险管理制度,并适时调整; (二)建立健全公司全面风险管理的经营管理架构,明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工,建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制; (三)制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案,确保其有效落实;对其进行监督,及时分析原因,并根据董事会的授权进行处理; (四)定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况,解决风险管理中存在的问题并向董事会报告; (五)建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系; (六)建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制; (七)根据法律法规的要求和董事会授权的其他风险管理职责。 公司设立风控与合规委员会、信息技术治理委员会、创新业务和产品终审委员会、自营业务领导小组、经纪业务领导小组、信用业务领导小组、资产管理业务领导小组、投行业务及内核领导小组、区域性股权交易市场内核小组等非常设机构,根据公司授权履行在各自的业务管理、决策范围内的风险管控职责和义

	务。
第八条 公司指定或者任命一名高级管理人员担任首席风险官，负责组织落实公司全面风险管理的具体工作。首席风险官不得兼任或者分管与其职责相冲突的职务或者部门。 公司对首席风险官履职提供充分保障，保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权。首席风险官有权参加或者列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。 公司保障首席风险官的独立性。公司股东、董事不得违反规定的程序，直接向首席风险官下达指令或者干涉其工作。 公司各部门、分支机构及其工作人员发现风险隐患时，应当主动、及时地向首席风险官报告，首席风险官根据风险隐患重要程度不同，逐级向公司经营管理层、董事会和外部监管机构报告。	第九条 公司任命一名符合法规要求任职条件的高级管理人员担任首席风险官，负责组织落实公司全面风险管理的具体工作。首席风险官不得兼任或者分管与其职责相冲突的职务或者部门。 公司对首席风险官履职提供充分保障，保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权。首席风险官有权参加或者列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。 公司保障首席风险官的独立性。公司股东、董事不得违反规定的程序，直接向首席风险官下达指令或者干涉其工作。 公司各部门、分支机构及其工作人员发现风险隐患时，应当主动、及时地向首席风险官报告，首席风险官根据风险隐患重要程度不同，逐级向公司经营管理层、董事会、监事会和外部监管机构报告。
第九条 公司相关风险管理职能部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。	第十条 公司相关风险管理职能部门在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。
第十条 公司设立风险监管部、合规管理部与稽核部等内部监督检查部门，独立履行风险管理职能，对董事长负责，并同时向公司经营管理层、监事会和首席风险官报告公司风险管理的情况。公司配备充足的熟悉证券业务与	第十一条 公司设立风险监管部、发行审核部、合规管理部与稽核部等内部监督检查部门，独立履行风险管理职能，对董事会负责，并同时向公司经营管理层、监事会和首席风险官报告公司风险管理的情况。公司配备充足的

风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持，以保障其胜任风险管理工作。 风险监管部负责倡导全员风险意识，进行公司风险管理体系和策略的研究；针对市场风险、信用风险、操作风险等风险类型，及时识别已开展的各项业务和创新业务可能存在的风险，督导业务部门在业务运行、业务创新中建立与完善各项内部控制制度和风险管理流程；通过连接各业务管理系统、建设电子信息监控系统，对公司经营活动、业务开展事前和事中的风险监管点或风险监管项目实施审核、监控与管理；建立以净资本为核心的风控指标监控体系，组织进行全面压力测试和专项压力测试工作；按照公司有关规定与控股子公司进行风险监管对接；建立风险监管信息内部报送与传递机制，修正偏差以达到风险的分担、转移、整合和消除。 合规管理部负责督导和协助经理层有效管理公司各业务法律风险和合规风险，对公司及其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，履行合规政策开发、合规审查、合规咨询、监督检查、培训教育等合规支持和合规控制职责；负责对公司的业务开展及合同内容的合法性、约定权利义务的对等性、条款的完备性以及是否存在重大缺陷或显失公平等法律事项进行审核；对已获准的合同及业务提供相应的法律服务；管理公司的诉讼案件；协助司法机关查询、冻结及执行工作；配合公司相关部门开展专项法律培训，	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，以保障其胜任风险管理工作。 风险监管部负责倡导全员风险意识，进行公司全面风险管理体系和策略的研究；针对市场风险、信用风险、操作风险等风险类型，及时识别已开展的各项业务和创新业务可能存在的风险，督导业务部门在业务运行、业务创新中建立与完善各项内部控制制度和风险管理流程；通过连接各业务管理系统、建设电子信息监控系统，对公司经营活动、业务开展事前和事中的风险监管点或风险监管项目实施审核、监控与管理；建立以净资本为核心的风控指标监控体系，组织进行全面压力测试和专项压力测试工作；按照公司有关规定与子公司进行风险监管对接；建立风险监管信息内部报送与传递机制，修正偏差以达到风险的分担、转移、整合和消除。 发行审核部负责对投行和债券业务进行全程动态监管，建立完善投行和债券业务的内部控制制度和风险管理流程，对投行和债券项目进行立项、预审、现场检查、组织内核、底稿验收等质量控制活动，并就投行及债券业务中的风险事件与合规事项向首席风险官、合规总监报告。 合规管理部负责督导和协助经理层有效管理公司各业务法律风险和合规风险，对公司及其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，履行合规政策开
--	--

防范法律风险。 稽核部负责对公司所属部门及分支机构的业务、财务、会计及其他经营管理活动的合法性、合规性、真实性、效益性等履行检查、评价、报告和建议职能。	发、合规审查、合规咨询、监督检查、培训教育等合规支持和合规控制职责；负责对公司的业务开展及合同内容的合法性、约定权利义务的对等性、条款的完备性以及是否存在重大缺陷或显失公平等法律事项进行审核；对已获准的合同及业务提供相应的法律服务；负责实施公司反洗钱工作，牵头履行法人机构反洗钱相关职责；管理公司的诉讼案件；协助司法机关查询、冻结及执行工作；配合公司相关部门开展专项法律培训，防范法律风险。 稽核部负责对公司所属部门及分支机构的业务、财务、会计及其他经营管理活动的合法性、合规性、真实性、效益性等履行检查、评价、报告和建议职能。
第十一条 公司其他风险管理职能部门及其职责： 资金计划部是公司自有资金的管理部门，在财务会计部和风险监管部等部门协助下负责流动性风险管理工作； 信息技术部是公司信息技术系统的管理部门，负责公司信息技术风险管理工作，信息技术部本身的监督评估工作由稽核部聘请外部机构予以完成； 董事会办公室是公司信息披露、投资者关系、对外沟通等事务的管理部门，负责公共关系有关声誉风险管理工作； 财务会计部、客户资金存管中心和人力资源部等其他业务支持与管理部门，在各自职责范围内履行相应的风险管理职能。	第十二条 公司其他风险管理职能部门及其职责： 资金计划部在财务会计部和风险监管部等部门协助下负责公司及子公司流动性风险管理工作； 信息技术总部是公司信息技术系统的管理部门，负责公司信息技术风险管理工作，信息技术总部本身的监督评估工作由稽核部聘请外部机构予以完成； 董事会办公室是公司信息披露、投资者关系、对外沟通等事务的管理部门，负责公共关系有关声誉风险管理工作； 财务会计部、运营总部和人力资源部等其他业务支持与管理部门，在各自职责范围内履行相应的风险管理职能。

第十二条 公司各业务部门、分支机构和高级管理人员应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险,及时识别、评估、应对、报告相关风险,并承担风险管理有效性的直接责任。各业务管理部门和分支机构负责人为风险控制的第一责任人,各分管高管承担相应的领导责任。	第十三条 公司各业务部门、分支机构、子公司和高级管理人员应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险,及时识别、评估、应对、报告相关风险,并承担风险管理有效性的直接责任。各业务管理部门和分支机构负责人为风险控制的第一责任人,各分管高管承担相应的领导责任。
第十三条 各业务部门和业务管理部门设立风险管理岗位(除另行指定外,由部门合规管理岗位人员兼任),在首席风险官与内部监督检查部门的指导下,负责公司各项业务管理和风险管理制度的落实,监督执行各项业务操作流程,与风险管理职能部门建立直接、有效的沟通,对业务操作过程中发现的内部控制缺陷及风险点及时反馈,提出整改或完善的意见或建议,有效识别和管理本单位业务经营中面临的各种风险,履行一线风险控制职能。	第十四条 各业务部门设立风险管理岗位(除另行指定外,由部门合规管理岗位人员兼任),承担管理职能的业务部门配备专职风险管理人员,在首席风险官与内部监督检查部门的指导下,负责公司各项业务管理和风险管理制度的落实,监督执行各项业务操作流程,与风险管理职能部门建立直接、有效的沟通,对业务操作过程中发现的内部控制缺陷及风险点及时反馈,提出整改或完善的意见或建议,有效识别和管理本单位业务经营中面临的各种风险,履行一线风险控制职能。风险管理人员不得兼任与风险管理职责相冲突的职务。
	第十五条 根据监管要求并适应经营发展需求,公司制定并持续完善各项业务风险管理制度,针对不同风险类型制定可操作的风险识别、评估、监测、应对、报告的方法和流程,并通过评估、稽核、检查和绩效考核等手段保证风险管理制度的贯彻落实。
第十四条 公司根据自身的整体发展战略,确定风险偏好,制定风险管理政策。风险管理政策应与公司的发展规划、资本实力、经营目标和风险管理能力相适应,符合法律法规	第十六条 公司根据自身的整体发展战略,确定风险偏好,制定风险管理政策。风险管理政策应与公司的发展规划、资本实力、经营目标和风险管理能力相适应,符合法律法规

和监管要求。	和监管要求。
第十五条 公司各风险管理职能部门与业务部门共同制定包括风险容忍度和风险限额等风险控制指标,并通过情景分析、压力测试等方法计量风险、评估承受能力、指导资源配置。 风险指标经相应的授权机构审批后,逐级分解至各部门和分支机构,各部门和分支机构应当按照经批准的风险指标开展经营活动。	第十七条 公司各风险管理职能部门与业务部门共同制定包括风险容忍度和风险限额等风险控制指标,并通过压力测试等方法计量风险、评估承受能力、指导资源配置。 风险指标经相应的授权机构审批后,逐级分解至各部门、分支机构和子公司,各部门、分支机构和子公司机构应当按照经批准的指标开展经营活动和风险管控。
第十六条 公司建立并完善压力测试机制,及时根据业务发展情况和市场变化情况,对公司流动性风险、信用风险、市场风险等各类风险进行压力测试。	第十八条 公司建立并完善压力测试机制,及时根据业务发展情况和市场变化情况,对公司流动性风险、信用风险、市场风险等各类风险进行压力测试。
第十七条 公司实行授权管理体系,通过制度、流程、系统等方式,进行有效管理和控制,并确保业务经营活动受到制衡和监督。公司所有部门和分支机构均应在被授予的权限范围内开展工作,严禁越权从事经营活动。各部门在每年度的内控自我评价时应对自身及所属关键业务岗位的授权执行情况进行检查。	第十九条 公司建立健全授权管理体系,通过制度、流程、系统等方式,进行有效管理和控制,并确保业务经营活动受到制衡和监督。公司所有部门、分支机构及子公司均应在被授予的权限范围内开展工作,严禁越权从事经营活动。各部门在每年度的内控自我评价时应对自身及所属关键业务岗位的授权执行情况进行检查。
第十八条 公司投资管理、信息系统运维、清算交收等关键业务环节须建立操作日志,系统运行日志,操作留痕等措施,从技术上全面落实风险管理相关制度,实现责任事故的可追溯性,做到责任明确,有据可查。	第二十条 公司投资管理、信息系统运维、清算交收等关键业务环节须建立操作日志,系统运行日志,操作留痕等措施,从技术上全面落实风险管理相关制度,实现责任事故的可追溯性,做到责任明确,有据可查。

第十九条 公司将风险管理文化建设作为公司发展战略的组成部分，培育和塑造良好的风险管理文化，并融于企业文化建设的全过程中，在相关政策和制度文件中明确规定风险管理文化的建设要求和内容，在各层面营造风险管理文化的氛围。	第二十一条 公司将风险管理文化建设作为公司发展战略的组成部分，在全公司推行稳健的风险文化，形成与本公司相适应的风险管理理念、价值准则、职业操守，建立培训、传达和监督机制，在相关政策和制度文件中明确规定风险管理文化的建设要求和内容，在各层面营造风险管理文化的氛围。
第二十条 公司推行全员风险管理，培养和增强员工的风险意识和风险收益匹配原则，每一岗位员工都具有风险管理职能，都应该自觉执行公司各项风险管理制度和流程。	第二十二条 公司推行全员风险管理，培养和增强员工的风险意识和风险收益匹配原则，每一名员工都具有风险管理职能，对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。包括但不限于：通过学习、经验积累提高风险意识；谨慎处理工作中涉及的风险因素；发现风险隐患时主动应对并及时履行报告义务；自觉执行公司各项风险管理制度和流程。
	第二十三条 公司对各全资或控股子公司的风险管理工作实行垂直管理，将其纳入公司统一的全面风险管理体系，各全资或控股子公司应在母公司整体风险偏好和风险管理制度框架下，建立自身的风险管理组织架构、制度流程、信息技术系统和风控指标体系，保障全面风险管理的一致性和有效性。 各全资或控股子公司应当任命一名高级管理人员负责子公司的全面风险管理工作，子公司负责全面风险管理工作的负责人不得兼任或者分管与其职责相冲突的职务或者部门。

	第二十四条 公司将全面风险管理纳入内部审计范畴，对全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。内部审计发现问题的，审计部门应督促相关责任人及时整改，并跟踪检查整改措施的落实情况。
第二十一条 公司各部门通过全面、系统、持续地收集和分析可能影响实现经营目标的内外部信息，持续识别公司面临的风险及其来源、特征、形成条件和潜在影响，并按业务、部门和风险类型等进行分类，定期或不定期更新各流程内控风险矩阵，修订完善公司相关制度和流程。	第二十五条 公司各部门通过全面、系统、持续地收集和分析可能影响实现经营目标的内外部信息，识别公司面临的风险及其来源、特征、形成条件和潜在影响，并按业务、部门和风险类型等进行分类，定期或不定期更新各流程内控风险矩阵，修订完善公司相关制度和流程。
第二十二条 公司根据风险的影响程度和发生可能性等建立风险等级评估标准，各部门应采取定性与定量相结合的方法，对识别的风险进行分析计量；风险管理部门充分关注风险的关联性，对公司层面的风险进行总量汇总，审慎评估公司面临的总体风险水平。	第二十六条 公司根据风险的影响程度和发生可能性等建立风险等级评估标准，各部门应采取定性与定量相结合的方法，对识别的风险进行分析计量并进行等级评价或量化排序，确定重点关注和优先控制的风险。风险管理部门应充分关注风险的关联性，对公司层面的风险进行总量汇总，审慎评估公司面临的总体风险水平。
第二十三条 公司业务部门和财务部门负责建立金融工具估值的方法、模型和计量流程，建立业务部门、分支机构与风险管理部门、财务部门的协调机制，确保风险计量基础的科学性。金融工具的估值及风险计量如果存在分歧，以风险管理部门确认的数值为准。	第二十七条 公司业务部门和财务部门负责建立金融工具估值的方法、模型和计量流程，建立业务部门、分支机构、子公司与风险管理部门、财务部门的协调机制，确保风险计量基础的科学性。金融工具的估值及风险计量如果存在分歧，以风险管理部门确认的数值为准。

第二十四条 公司可通过风险价值、信用敞口、敏感性分析、压力测试等方法或模型来计量和评估市场风险、信用风险等可量化的风险，审慎评估所选方法或模型的局限性，并采用有效手段进行补充。风险管理部门应不定期对估值与风险计量模型的有效性进行检验和评价。	第二十八条 公司可通过风险价值、信用敞口、敏感性分析、压力测试等方法或模型来计量和评估市场风险、信用风险等可量化的风险，审慎评估所选方法或模型的局限性，并采用有效手段进行补充。风险管理部门应会同相关部门定期或不定期对估值与风险计量模型的有效性进行检验和评价。
第二十五条 各业务部门制订的重大投资计划和创新业务方案应包含业务部门自身对于计划、方案的风险判断和采取的风险管理措施，并经相关风险管理职能部门进行风险评估。风险管理职能部门对计划方案中可能存在的风险进行审查和识别，对其产生结果的影响程度进行评估，对计划方案中相应的风险管理措施是否充分有效等进行分析，并出具风险评估报告。 原则上严禁开展未经风险评估、未落实风险管理措施及未经公司授权的业务。	第二十九条 开展创新业务的部门、分支机构和子公司应当充分了解新业务的运作模式、估值模型，会同风险管理部门合理设定风险管理的基本假设、评估各主要风险以及压力情景下的潜在损失。 各业务部门、分支机构和子公司制订的重大投资计划和创新业务方案应包含自身对于计划、方案的风险判断和采取的风险管理措施，并经相关风险管理职能部门进行风险评估。风险管理职能部门对计划方案中可能存在的风险进行审查和识别，对其产生结果的影响程度进行评估，对计划方案中相应的风险管理措施是否充分有效等进行分析，并出具风险评估报告。
第二十六条 公司建立创新业务及产品的风险评估体系，建立专家审核机制，通过初审、复审和终审的三级审核机制确保新业务、新产品的组织结构、业务模式、风险状况经过充分论证，符合公司的风险管理政策，并通过制定相关风险限额和控制流程，履行相应的授权和审批程序，配备相应的人员、系统、资本及实施培训等措施，确保新业务、新产品的风	第三十条 公司建立创新业务及产品的风险评估体系，建立专家审核机制，通过初审、复审和终审的三级审核机制确保新业务、新产品的组织结构、业务模式、风险状况经过充分论证，符合公司的风险管理政策，并通过制定相关风险限额和控制流程，履行相应的授权和审批程序，配备相应的人员、系统、资本及实施培训等措施，确保新业务、新产品的风险可

险可测、可控、可承受。 公司上线新的业务管理和清算等信息系统，应经过事先模拟测试、演练、验收后方可正式上线。严禁交易、清算等系统未经测试、验收即正式上线使用。	测、可控、可承受。 公司上线新的业务管理和清算等信息系统，应经过事先模拟测试、演练、验收后方可正式上线。严禁交易、清算等系统未经测试、验收即正式上线使用。
	第三十一条 公司建立并逐步完善数据治理和质量控制机制。积累真实、准确、完整的内部和外部数据，用于风险识别、计量、评估、监测和报告。公司将数据治理纳入公司整体信息技术建设战略规划，制定数据标准，涵盖数据源管理、数据库建设、数据质量监测等环节。
第二十七条 公司应建立与业务复杂程度和风险指标体系相适应的风险管控信息系统，对风险进行计量、汇总、预警和监控，并逐步实现同一业务、同一客户相关风险信息的集中管理，以符合公司整体风险管理的需要。 对于风险监控信息系统不能监控的领域，通过业务部门及时报备、不定期的检查、评估，将各项业务风险纳入监控范围，努力消除各项风险隐患、不留下风险盲区。	第三十二条 公司建立与业务复杂程度和风险指标体系相适应的风险管控系统，逐步实现覆盖各风险类型、业务条线、各个部门、分支机构及子公司，对风险进行计量、汇总、预警和监控，以及同一业务、同一客户相关风险信息的集中管理的目标，以符合公司整体风险管理的需要。公司每年应制定风险管控信息系统专项预算。 对于风险监控信息系统不能监控的领域，通过业务部门及时报备、不定期的检查、评估，将各项业务风险纳入监控范围，努力消除各项风险隐患、不留下风险盲区。
第二十八条 公司业务和风险管理部门建立逐日盯市等机制，准确计算、动态监控关键风险指标情况，判断和预测各类风险指标的变化，及时预警超越各类、各级风险限额的情形，并明确不同级别的异常情况的报告路径和处理办法。	第三十三条 公司业务和风险管理部门建立逐日盯市等机制，准确计算、动态监控关键风险指标情况，判断和预测各类风险指标的变化，及时预警超越各类、各级风险限额的情形，并明确不同级别的异常情况的报告路径和处理办法。

第二十九条 公司根据风险评估和预警结果，选择与公司风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略，建立合理、有效的资产减值、风险对冲、资本补充、规模调整、资产负债管理等应对机制。	第三十四条 公司根据风险评估和预警结果，选择与公司风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略，建立合理、有效的资产减值、风险对冲、资本补充、规模调整、资产负债管理等应对机制。
第三十条 公司建立以净资本为核心的风险控制指标体系和各项业务规模与净资本水平的动态挂钩机制，动态、实时地监控净资本及风险控制指标变化，保证公司业务发展与净资本充足水平相匹配，确保公司所有净资本指标均符合中国证监会的监管要求。	第三十五条 公司建立以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系，根据自身资产负债状况和业务发展情况，建立动态的风险控制指标监控和资本补足机制，确保净资本等各项风险控制指标在任一时点都符合中国证监会的监管要求。
第三十一条 各经营管理部门及职能部门应负责对各自职责范围内的业务及工作进行检查、评估，督促各项规章制度的执行及各项风险控制措施的落实。各经营管理部门及分支机构的合规风控岗位人员每月向合规风控部门全面报告本单位的风险管理情况。	第三十六条 各经营管理部门及职能部门应负责对各自职责范围内的业务及工作进行检查、评估，督促各项规章制度的执行及各项风险控制措施的落实。各经营管理部门及分支机构的合规风控岗位人员每月向合规风控部门全面报告本单位的风险管理情况。
第三十二条 合规管理部定期或不定期对各部门制度及执业行为合规性及执行情况进行检查；风险监管部根据公司各阶段风险控制的不同重点，对重点风险业务进行专项检查，督促相关制度的执行及风险控制措施的落实；稽核部负责根据监管要求和公司管理需要对公司各部门、各分支机构进行内控审计、离任审计或全面稽核。	第三十七条 合规管理部定期或不定期对各部门制度及执业行为合规性及执行情况进行检查；风险监管部根据公司各阶段风险控制的不同重点，对重点风险业务进行专项检查，督促相关制度的执行及风险控制措施的落实；发行审核部对投行和债券业务项目进行检查；稽核部负责根据监管要求和公司管理需要对公司各部门、各分支机构进行内控审计、离任审计或全面稽核。
第三十三条 公司针对流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件建立风险应急机制。各相关部门应根据各自开展业务的规	第三十八条 公司针对流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件建立风险应急机制。各相关部门应根据各自开展业务的规

模、性质、复杂程度、风险水平及组织架构，针对流动性危机、非预期的市场大幅波动、信息系统事故、关键操作差错等重大风险和突发事件建立风险应急机制，制订并完善应急处置方案。	模、性质、复杂程度、风险水平及组织架构，针对流动性危机、非预期的市场大幅波动、信息系统事故、关键操作差错等重大风险和突发事件建立风险应急机制，制订并完善应急处置方案。
第三十四条 各部门制订应急处置机制或流程时需明确应急触发条件、风险处置的组织体系、措施、方法和程序，并通过压力测试、应急演练等机制进行持续改进。应急处置方案应包括但不限于以下内容： （一）充分、合理设定应急处置的触发条件或情景； （二）明确风险处置的组织体系、各参与人员或岗位的权限及职责，建立有针对性的应急措施、方法和操作程序； （三）应急处置期间的信息沟通途径和报告程序； （四）应急处置的演练、压力测试和持续改进机制； （五）出现意外突发事件的原因分析要求与责任追究机制。	第三十九条 各部门制订应急处置机制或流程时需明确应急触发条件、风险处置的组织体系、措施、方法和程序，并通过压力测试、应急演练等机制进行持续改进。应急处置方案应包括但不限于以下内容： （一）充分、合理设定应急处置的触发条件或情景； （二）明确风险处置的组织体系、各参与人员或岗位的权限及职责，建立有针对性的应急措施、方法和操作程序； （三）应急处置期间的信息沟通途径和报告程序； （四）应急处置的演练、压力测试和持续改进机制； （五）出现意外突发事件的原因分析要求与责任追究机制。
第三十五条 公司在分支机构、业务部门、风险管理部门、经营管理层、董事会之间建立畅通的风险信息沟通机制，确保相关信息传递与反馈的及时、准确、完整。	第四十条 公司在分支机构、子公司、业务部门、风险管理部门、经营管理层、董事会之间建立畅通的风险信息沟通机制，确保相关信息传递与反馈的及时、准确、完整。

第三十六条 公司建立内部风险报告机制,使公司及时掌握各业务及分支机构经营中的风险情况,并采取措施促进公司各经营管理部门和各分支机构安全稳健地持续经营。 公司的内部风险报告包括定期的风险报告与临时的风险报告两类:各部门和分支机构应当定期对各自部门内部风险管理有效性的情况进行评估和检查,并向分管领导与合规风控部门提交定期报告;发生风险管理重大事项的,各部门和分支机构的所有员工应当及时、完整和准确地向合规风控部门、相关业务支持部门和管理部门提交临时报告。	第四十一条 公司建立内部风险报告机制,使公司及时掌握各业务、分支机构及子公司经营中的风险情况,并采取措施促进公司各经营管理部门、各分支机构和子公司安全稳健地持续经营。 公司的内部风险报告包括定期的风险报告与临时的风险报告两类:各部门、分支机构和子公司应当定期对各自内部风险管理有效性的情况进行评估和检查,并向分管领导与合规风控部门提交定期报告;发生风险管理重大事项的,各部门、分支机构和子公司的所有员工应当及时、完整和准确地向合规风控部门、相关业务支持部门和管理部门提交临时报告。
第三十七条 合规风控部门、相关业务支持部门和管理部门在得到风险报告后应互相沟通,对报告所涉及的风险和危害程度进行评估,并按照各自职责采取相应控制措施化解风险,寻找漏洞、加强控制。	第四十二条 风险管理职能部门、相关业务支持部门和管理部门在得到风险报告后应互相沟通,对报告所涉及的风险和危害程度进行评估,并按照各自职责采取相应控制措施化解风险,寻找漏洞、加强控制。
第三十八条 风险管理职能部门建立有效的风险报告机制,向首席风险官和公司经营管理层提交公司风险管理日报、月报、年报等定期报告,反映风险识别、评估结果和应对方案,对重大风险应提供专项评估报告,确保经营管理层及时、充分了解公司风险状况。经理层应当向董事会定期报告公司风险状况,重大风险情况应及时报告。	第四十三条 风险管理职能部门建立有效的风险报告机制,向首席风险官和公司经营管理层提交公司风险管理日报、月报、年报等定期报告,反映风险识别、评估结果和应对方案,对重大风险应提供专项评估报告,确保经营管理层及时、充分了解公司风险状况。经营管理层应当向董事会定期报告公司风险状况,重大风险情况应及时报告。
第三十九条 风险管理职能部门发现业务运作存在风险隐患或风险指标超限额等异常情形时,立即向公司领导报告并与业务部	第四十四条 风险管理职能部门发现业务运作存在风险隐患或风险指标超限额等异常情形时,立即向公司领导报告并与业务部

门、分支机构及时沟通，了解情况和原因，督促相关责任部门 负责落实整改 。	门、分支机构、 子公司 及时沟通，了解情况和原因，督促相关责任部门 在规定时间内采取措施进行整改，并及时向首席风险官报告 。
第四十条 内部监督检查部门在日常监督、检查、审查、稽核审计过程中，发现经营管理部门日常经营管理存在内控缺陷、风险或风险隐患等情况，可通过发出内控监督文书要求经营管理部门作出书面解释、分析，采取整改、完善措施，反馈执行结果。经营管理部门收到内控监督文书后，应当及时、全面、深入地分析风险产生的原因，并根据内控缺陷、风险或风险隐患的性质、风险状况、紧急程度等，制定、落实相应的整改措施或整改计划，并将风险处理结果反馈发文部门。	—
第四十一条 公司对各部门及分支机构的风险管理绩效定期进行评价，评价结果纳入绩效考核体系。风险管理评分作为公司对各业务绩效评估（KPI）的评分指标之一，原则上合规风控指标权重不低于 10%。具体考评办法由公司另行制定。	第四十五条 公司对各部门、分支机构、子公司的风险管理绩效定期进行评价，评价结果纳入绩效考核体系。风险管理评分作为公司对各业务绩效评估（KPI）的评分指标之一，原则上合规风控指标权重不低于 10%。具体考评办法由公司另行制定。
第四十二条 公司各部门的风险管理评价由首席风险官、合规总监会同内部监督检查部门负责组织完成，财务、资金、清算、信息技术及相关管理部门予以配合；对首席风险官和内部监督检查部门的绩效评价按公司相关绩效考核办法组织完成。	第四十六条 公司各部门、分支机构、子公司的风险管理评价由首席风险官、合规总监会同内部监督检查部门负责组织完成，财务、资金、运营、信息技术及相关管理部门予以配合；对首席风险官和内部监督检查部门的绩效评价按公司相关绩效考核办法组织完成。
第四十三条 公司通过每年度的内部控制规范实施来定期评估全面风险管理体系，向董事会报告评估情况，并根据评估结果及时改	第四十七条 公司通过每年度的内部控制规范实施来定期评估全面风险管理体系，向董事会报告评估情况，并根据评估结果及时改

进风险管理工作。	进风险管理工作。
第四十四条 公司对业务部门、各管理部门在风险管理方面的失职行为进行问责。业务部门和归口管理部门未执行公司制度流程或发现风险、隐患或漏洞没有及时报告并制订规避措施或收到风险通知书后未及时整改的，公司对业务部门和归口管理部门进行问责，分管领导承担相应的领导责任。风险管理职能部门未按照制度要求履行相应职责或发现风险事项未进行风险揭示的，公司对风险管理职能部门进行问责，分管领导承担相应的领导责任。具体问责方式按照《公司员工奖惩办法》等制度执行。	第四十八条 公司对业务部门、各管理部门在风险管理方面的失职行为进行问责。业务部门和归口管理部门未执行公司制度流程或发现风险、隐患或漏洞没有及时报告并制订规避措施或收到风险通知书后未及时整改的，公司对业务部门和归口管理部门进行问责，分管领导承担相应的领导责任。风险管理职能部门未按照制度要求履行相应职责或发现风险事项未进行风险揭示的，公司对风险管理职能部门进行问责，分管领导承担相应的领导责任。具体问责方式按照《公司员工奖惩办法》等制度执行。
第四十五条 公司所有部门和人员应积极配合首席风险官和风险管理职能部门对公司风险管控情况的检查和评价，不得以任何形式干预、阻挠，不得隐瞒真实情况，弄虚作假。对于不配合风险管理工作、拒绝提供资料、提供虚假资料、拒不执行风险控制措施的，公司将责令其改正，并对负有直接责任的主管人员和其他责任人员，依照公司有关规定视情节轻重，分别给予经济处罚、通报批评、警告、记过直至撤职、开除等处理；构成犯罪的，移交司法机关追究刑事责任。	第四十九条 公司所有部门和人员应积极配合首席风险官和风险管理职能部门对公司风险管控情况的检查和评价，不得以任何形式干预、阻挠，不得隐瞒真实情况，弄虚作假。对于不配合风险管理工作、拒绝提供资料、提供虚假资料、拒不执行风险控制措施的，公司将责令其改正，并对负有直接责任的主管人员和其他责任人员，依照公司有关规定视情节轻重，分别给予经济处罚、通报批评、警告、记过直至撤职、开除等处理；构成犯罪的，移交司法机关追究刑事责任。
第四十六条 公司各全资或控股子公司应建立与母公司一致的风险管理文化与政策，建立完善的风险管理制度和内部控制机制，建立重大事项报告制度和审议机制，真实、准确、完整、及时、充分地向母公司报告重大业务事	—

项、重大财务事项以及其他重大风险事项。 公司相关部门应定期或不定期对各全资或控股子公司的风险管理体系有效性进行检查和评估。	
第四十七条 本制度的修订和解释权归公司董事会，自董事会通过之日起生效并施行。原《国元证券股份有限公司风险管理制度》同时废止。	第五十条 本制度的修订和解释权归公司董事会，自董事会通过之日起生效并施行。

修订后的《国元证券股份有限公司全面风险管理制度》见巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。

（四）审议通过《关于修订〈国元证券股份有限公司风险控制指标管理办法〉的议案》。

根据中国证监会发布新修订的《证券公司风险控制指标管理办法》要求，同意公司修订的《国元证券股份有限公司风险控制指标管理办法》。

表决结果：赞成票【11】票，反对票【0】票，弃权票【0】票，审议通过本议案。

《国元证券股份有限公司风险控制指标管理办法》修订内容如下：

原文	修订稿
第一章 总则	第一章 总则
第一条 为了建立以净资本为核心的风险控制指标体系，加强公司风险监管， 促进公司合规经营 ，有效防范和化解经营风险，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 》等规定，制定本办法。	第一条 为了建立以净资本 和流动性 为核心的风险控制指标体系，加强公司风险监管 和内部控制 ， 提升风险管理水平 ，有效防范和化解经营风险，根据《证券公司风险控制指标管理办法》等规定，制定本办法。
第二条 公司按照中国证监会发布实施的净资本计算标准、风险资本准备计算标准、各项业务规模的计算口径，计算净资本和风险资本准备，编制净资本计算表、风险资本准备计算表和风险控制	第二条 公司按照中国证监会发布的证券公司风险控制指标计算标准的规定， 遵循审慎、实质重于形式的原则 ，计算净资本、风险覆盖率、资本杠杆率、流动性覆盖率、净稳定资金率等各项风险

指标监管报表。	控制指标，编制净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表、风险控制指标计算表等监管报表（以下统称风险控制指标监管报表）。
第三条 公司在投资或开展未规定风险调整比例或者风险资本准备计算比例的新产品、新业务前，应当按照规定事先向中国证监会、安徽证监局报告或者报批。公司按照中国证监会确定的相应风险调整比例和风险资本准备计算比例执行。	第三条 公司在投资或开展未规定风险控制指标标准及计算要求的新产品、新业务前，应当按照规定事先向中国证监会、安徽证监局报告或者报批，待中国证监会确定相应的风险控制指标标准及计算要求后执行。
第四条 净资本等各项风险控制指标数据的生成过程及计算结果应做到真实、准确、完整，并接受监管部门的定期或者不定期检查。	第四条 净资本等各项风险控制指标数据的生成过程及计算结果应做到真实、准确、完整，并接受监管部门的定期或者不定期检查。公司聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所对年度风险控制指标监管报表进行审计。
第五条 公司根据资产负债状况和业务发展规划，建立动态的风险控制指标监控和补足机制，净资本等各项风险控制指标在任一时点都应符合规定标准。 公司在开展各项业务及分配利润前，应对风险控制指标进行敏感性分析，合理确定有关业务及分配利润的最大规模。 公司建立健全压力测试机制，及时根据市场变化情况对风险控制指标进行压力测试。	第五条 公司根据资产负债状况和业务发展规划，建立动态的风险控制指标监控和资本补足机制，确保净资本等各项风险控制指标在任一时点都符合规定标准。当净资本等各项风险控制指标接近证监会规定的监管标准时，公司将采用减少风险性较高的业务、投资品种或规模、追讨往来账项、转让长期股权投资、处置有形或无形资产、加大提取任意盈余公积、减少或暂停利润分配、发行次级债或债转股、募集资本金等方式补充资本。
	第六条 公司应建立健全压力测试机制，及时根据市场变化情况及监管部门要求，对公司风险控制指标进行压力测试。压力测试结果显示风险超过公司自身承受能力范围的，公司应采取措施控制业务规模或降低风险。在发生重大业务事项及分配利润前，公司应对风险控制指标进行压力测试，合理

	确定有关业务及分配利润的最大规模。
第六条 公司建立风险控制指标动态监控系统（以下简称“动态监控系统”），实现风险控制指标的实时动态监控和自动预警。动态监控系统的功能应符合监管部门和自律组织的要求。	—
第七条 公司向安徽证监局开放动态监控系统数据接口，并提供履行监管职责所需的查询权限。	—
第二章 组织体系	第二章 组织体系
第八条 公司董事会及其风险管理委员会为风险控制指标管理工作的决策机构，负责各项风险控制指标的审批、监督等工作。	第七条 公司董事会及其风险管理委员会为风险控制指标管理工作的决策机构，负责各项风险控制指标的审批、监督等工作。
第九条 公司经营管理层下设的 风险控制委员会 为风险控制指标管理工作的执行机构，负责公司各项风险控制指标及其动态监控系统的日常工作并监督有关部门具体落实。	第八条 公司经营管理层下设的 风控与合规委员会 为风险控制指标管理工作的执行机构，负责公司各项风险控制指标及其动态监控系统的日常工作并监督有关部门具体落实。
第十条 公司 合规总监 担任风险控制指标管理工作的总协调人，负责外部沟通和内部协调，向 风险控制委员会 报告风险监控信息，负责管理风险控制指标动态监控系统的建设与运行。	第九条 公司 首席风险官 担任风险控制指标管理工作的总协调人，负责外部沟通和内部协调，负责向董事会风险管理委员会报告半年度、年度风险控制指标的具体情况和达标情况，向公司领导报告风险控制指标监控信息，负责管理动态监控系统的建设与运行及压力测试工作。
第十一条 公司风险控制指标管理及其动态监控系统的设计开发、运行管理、系统维护等工作由下列部门具体负责： 财务会计部负责提供净资本计算所需的基础数据源，并保证基础数据的实时、真实、准确、完整、合规；负责实时维护净资本监控系统无法自动采集的数据，编制净资本计算表；负责在公司进行	第十条 公司风险控制指标管理及其动态监控系统的设计开发、运行管理、系统维护等工作由下列部门具体负责： 财务会计部负责提供净资本计算所需的基础数据源，并保证基础数据的实时、真实、准确、完整、合规；负责实时维护净资本监控系统无法自动采集的数据，编制净资本计算表和 表内外资产总额

利润分配前，对风险控制指标进行敏感性分析，合理确定分配利润的最大规模，并向董事会报告。 风险监管部负责牵头研究并协调解决净资本监控系统的建设开发、运行管理和系统维护等工作；负责净资本监控系统的日常运行管理并向安徽证监局开放数据接口；负责编制风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表，实时动态监控指标变化，做到及时预警、分级报告；根据相关业务部门提供的测算数据，负责对净资本等风险控制指标进行敏感性分析、压力测试，提出业务规模调整建议；负责定期或不定期对动态监控系统进行后续检查，及时发现数据误差的主要来源，并采取有效措施保证按日计算的各項风险控制指标的正确性。 合规管理部负责定期或不定期对风险控制指标的真实性、准确性、完整性和相关内控制度的执行情况进行评价，对存在的问题及时反馈，并出具合规检查报告。在公司风险控制指标达到预警标准时，按照监管部门的要求增加对风险控制指标的检查频率，并提交有关风险控制指标水平的报告。 信息技术部负责动态监控系统运行维护，定期或不定期对系统的可靠性和安全性进行检查，确保系统稳定、高效运行。 董事会办公室负责向全体董事、全体股东报告或披露公司风险控制指标的具体情况和达标情况。 各业务部门应按本办法第 45 条规定，在开展业务前，主动向风险监管部提交风险控制指标分析测试的基础数据，以合理确定有关业务的最大规模。	计算表；负责在公司进行利润分配前，对风险控制指标进行敏感性分析，合理确定分配利润的最大规模，并向董事会报告。 风险监管部负责牵头研究并协调解决净资本动态监控系统的建设开发、运行管理和系统维护等工作中的问题；负责净资本动态监控系统的日常运行管理，督促相关部门完成动态监控系统所需数据的采集、录入、整理，并向安徽证监局开放数据接口；负责编制风险资本准备计算表和风险控制指标计算表，实时动态监控指标变化，做到及时预警、分级报告；根据相关业务部门提供的测算数据，负责对净资本等风险控制指标进行压力测试，提出业务规模调整建议；负责对净资本动态监控系统进行后续检查。 资金计划部负责编制流动性覆盖率计算表和净稳定资金率计算表，实时动态监控流动性指标变化，做到及时预警、分级报告；负责研究并协调解决流动性风险动态监控系统的建设开发、运行管理和系统维护等工作；负责流动性风险动态监控系统的日常运行管理；根据相关业务部门提供的测算数据，负责对流动性风险控制指标进行压力测试，提出业务规模调整建议；负责定期或不定期对流动性风险动态监控系统进行后续检查，及时发现数据误差的主要来源，并采取有效措施保证按日计算的流动性风险控制指标的正确性。 信息技术总部负责风险控制指标动态监控系统运行维护，定期或不定期对系统的可靠性和安全性进行检查，确保系统稳定、高效运行。 董事会办公室负责向全体董事、全体股东报告
---	---

	或披露公司风险控制指标的具体情况和达标情况，并取得相关签收确认证明文件。 各业务部门负责提供风险控制指标监管报表的基础数据，并对数据填报的及时性、真实性、准确性和完整性负责，相关原始资料和计算底稿以恰当方式留存，以备外部监管部门检查。同时，在开展重大业务前，应主动向风险监管部和资金计划部提交风险控制指标压力测试申请和测试所需基础数据，以合理确定有关业务的最大规模。
第三章 净资本及其计算	第三章 净资本及其计算
第十二条 净资本是指根据公司的业务范围和公司资产负债的流动性特点，在净资产的基础上对资产负债等项目和有关业务进行风险调整后得出的综合性风险控制指标。 净资本基本计算公式为：净资本=净资产-金融资产的风险调整-其他资产的风险调整-或有负债的风险调整-/+中国证监会认定或核准的其他调整项目	第十一条 证券公司净资本由核心净资本和附属净资本构成。其中： 核心净资本=净资产-资产项目的风险调整-或有负债的风险调整-/+中国证监会认定或核准的其他调整项目。 附属净资本=长期次级债×规定比例-/+中国证监会认定或核准的其他调整项目
第十三条 公司财务会计部应当按照中国证监会规定的证券公司净资本计算标准计算净资本。	第十二条 公司财务会计部应当按照中国证监会规定的证券公司净资本计算标准计算净资本。
第十四条 公司财务会计部计算净资本时，应当按规定对有关项目充分计提资产减值准备。资产减值准备的提取要符合监管部门规定的充足性和合理性要求。	第十三条 公司财务会计部计算核心净资本时，应当按规定对有关项目充分计提资产减值准备。资产减值准备的提取要符合监管部门规定的充足性和合理性要求。
第十五条 公司财务会计部计算净资本时，应当将不同科目中核算的金融资产合并计算，按照金融资产的属性统一进行风险调整。	—
第十六条 金融资产投资，按照金融资产的分	—

类和流动性情况采取不同比例进行风险调整。金融资产的分类中同时符合两个或者两个以上标准的，应当采用最高的比例进行风险调整。	
第十七条 公司以自有资金参与本公司设立的集合资产管理计划的，应当在集合资产管理合同中对投入资金的数额、期限和承担责任等进行约定，并在计算净资本时根据承担的责任相应扣减公司投入的资金。	—
第十八条 应收款项按照账龄的长短和可收回情况采取不同比例进行风险调整，账龄应当从业务发生时点开始计算。应收款项的分类中同时符合两个或者两个以上标准的，应当采用最高的比例进行风险调整。有证据表明难以收回的存出保证金项目以及逾期的拆出资金、买入返售金融资产、代理兑付债券、应收融资融券款等项目，应当并入应收款项项目并按照应收款项的扣减原则进行风险调整。	—
第十九条 公司财务会计部在编制净资本计算表的附注中，应充分披露公司期末或有事项的性质（如未决诉讼、未决仲裁、对外提供担保等）、涉及金额、形成原因和进展情况、可能发生的损失和预计损失的会计处理情况。对于很可能导致经济利益流出公司的或有事项，应当确认预计负债；对于不是很可能导致经济利益流出公司的或有事项，在计算净资本时，应当按照一定比例扣减或有负债。	第十四条 公司财务会计部应当根据公司期末或有事项的性质（如未决诉讼、未决仲裁、对外提供担保等）、涉及金额、形成原因和进展情况、可能发生的损失和预计损失进行相应会计处理。对于很可能导致经济利益流出公司的或有事项，应当确认预计负债；对于未确认预计负债，但仍可能导致经济利益流出公司的或有事项，在计算核心净资本时，应当作为或有负债，按照一定比例在净资本中予以扣减，并在净资本计算表的附注中披露。
第二十条 公司对控股证券业务子公司出具承诺书提供担保承诺的，应当按照担保承诺金额的一定比例扣减净资本。从事证券承销与保荐、证券	第十五条 公司对控股证券业务子公司出具承诺书提供担保承诺的，应当按照担保承诺金额的一定比例扣减核心净资本。从事证券承销与保荐、

资产管理业务等中国证监会认可的子公司可以将母公司提供的担保承诺按照一定比例计入净资产。	证券资产管理业务等中国证监会认可的子公司可以将母公司提供的担保承诺按照一定比例计入 核心 净资产。
第二十一条 公司借入次级债务的，可以在计算净资产时将所借入的次级债务按照一定比例计入净资产。公司向股东或其关联企业借入的期限在5年以上并具有次级债务性质的长期借款，可以在计算净资产时将所借入的长期借款按照一定比例计入净资产。计入净资产的具体比例由中国证监会根据债务的到期期限和公司财务状况确定。	第十六条 公司向股东或机构投资者借入或发行的次级债，可以按照一定比例计入附属净资产或扣减风险资本准备。具体比例参考中国证监会相关规定执行。
第四章 风险控制指标标准	第四章 风险控制指标标准
第二十二条 公司净资产在任何时候都不得低于人民币 2 亿元。	第十七条 公司净资产在任何时候都不得低于人民币 2 亿元。
第二十三条 公司以净资产为核心的各项风险控制指标必须持续符合监管部门规定的监管标准。	第十八条 公司以净资产和流动性为核心的风险控制指标体系必须持续符合监管部门规定的监管标准： （一）风险覆盖率不得低于 100%； （二）资本杠杆率不得低于 8%； （三）流动性覆盖率不得低于 100%； （四）净稳定资金率不得低于 100%； （五）净资产/净资产不得低于 20%； （六）净资产/负债不得低于 8% ； （七）净资产/负债不得低于 10% ； 其中： 风险覆盖率=净资产/各项风险资本准备之和×100%； 资本杠杆率=核心净资产/表内外资产总额×100%； 流动性覆盖率=优质流动性资产/未来 30 天

	现金净流出量×100%; 净稳定资金率=可用稳定资金/所需稳定资金×100%。
第二十四条 公司相关部门应当按照中国证监会规定的证券公司风险资本准备计算标准计算各项风险资本准备。 对经纪业务，应当按照托管客户的交易结算资金总额计算经纪业务风险资本准备；对证券自营、证券承销、证券资产管理、融资融券业务，应当按照有关业务规模计算各项业务风险资本准备；设立子公司、分公司、证券营业部等分支机构的，应当计算分支机构风险资本准备；应当按照上一年营业费用总额计算营运风险资本准备。公司还应当按照中国证监会规定的其他项目和比例计算相应的风险资本准备。	第十九条 公司相关部门应当按照中国证监会规定的证券公司风险资本准备计算标准计算市场风险、信用风险、操作风险资本准备和特定风险资本准备。 市场风险资本准备按照各类金融工具市场风险特征的不同，用投资规模乘以风险系数计算；信用风险资本准备按照各表内外项目信用风险程度的不同，用资产规模乘以风险系数计算；操作风险资本准备按照各项业务收入的一定比例计算。特定风险资本准备由中国证监会根据特定产品或业务的风险特征，以及监督检查结果确定计算标准。

第二十五条 公司自营业务的规模 and 风险限额，由董事会审议确定。公司在制订自营业务规模、风险限额议案时以及自营部门的日常业务操作中，应持续符合监管部门规定的监管标准。	第二十条 公司自营业务的规模 and 风险限额，由董事会审议确定。公司在制订自营业务规模、风险限额议案时以及自营部门的日常业务操作中，应持续符合监管部门对该项业务的风险控制指标标准： （一）自营权益类证券及其衍生品的合计额不得超过净资本的 100%； （二）自营非权益类证券及其衍生品的合计额不得超过净资本的 500%； （三）持有一种权益类证券的成本不得超过净资本的 30%； （四）持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例不得超过 5%； （五）持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例不得超过 20%。 但因包销、中国证监会认可的做市业务及股票质押违约处理等导致的指标超标的情况，可予以豁免，不需要在风险控制指标计算表中填列，但应作备注说明。
第二十六条 公司为客户买卖证券提供融资融券服务，应当持续符合监管部门规定的监管标准。	第二十一条 公司为客户提供融资或融券服务，应当持续符合监管部门对该项业务的风险控制指标标准： （一）融资（含融券）的金额不得超过净资本的 400%； （二）对单一客户融资（含融券）业务规模不得超过净资本的 5%； （三）接受单只担保股票的市值不得超过该股票总市值的 20%。
第二十七条 中国证监会对各项风险控制指	第二十二条 中国证监会对各项风险控制指

标设置预警标准，对于规定“不得低于”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准的120%；对于规定“不得超过”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准的80%。	标设置预警标准，对于规定“不得低于”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准的120%；对于规定“不得超过”一定标准的风险控制指标，其预警标准是规定标准的80%。
第二十八条 公司结合自身实际情况，在不低于中国证监会规定的监管标准基础上，增设了内部监管标准，即关注标准。关注标准为合理关注的监控线（对于必须高于监管标准的指标，设置的预警值为不低于监管标准的130%；对于必须低于监管标准的指标，设置的预警值为不高于监管标准的70%）。	第二十三条 公司结合自身实际情况，在中国证监会规定的预警标准之上和预警标准与监管标准之间，增设了内部关注标准和内部监控标准，形成公司风险控制指标四级控制标准，分别为公司内部关注标准、证监会规定的预警标准、公司内部监控标准、证监会规定的监管标准。对于规定“不得低于”一定标准的风险控制指标，其四级控制标准分别是规定标准的130%、120%、110%、100%；对于规定“不得超过”一定标准的风险控制指标，其四级控制标准分别是规定标准的70%、80%、90%、100%。
第五章 动态监控系统的运行和维护	—
第二十九条 动态监控系统依托公司风险监控管理平台，自动采集财务系统基础数据，并利用资讯系统信息，生成净资产计算表、风险控制指标报表和风险资本准备计算表。	—
第三十条 风险监管部利用公司风险监控系統自动采集动态监控系统所需数据，并对所采集的交易系统、法人清算系统、财务系统等不同数据源的同一信息的数据或有勾稽关系的数据进行逻辑校验，确保数据真实、准确。动态监控系统设置并开启系统留痕功能，完整保存动态监控日志和对所有重大修改的记录，包括手工数据的录入等，具有系统备份功能。	—
第三十一条 动态监控系统显示数据时统一	—

拟定为：T 日数据，T+1 日完成填报，并能够动态显示和实时监控（T 为工作日）。	
第三十二条 公司建立严格的申请和登记制度，加强对动态监控系统的权限和密码管理。用户权限的设置、变动以及重置密码由使用部门提出申请，经使用部门和风险监管部负责人审批后，交由系统管理员进行设置，并保留完整的档案。	—
第三十三条 风险监管部根据公司的分级预警标准在动态监控系统中设置相应的风险监控阈值，通过系统的预警触发装置自动显示风险控制指标的变化。	—
第三十四条 为保证动态监控系统的高效运行，公司相关部门应按照以下步骤操作： 1、动态监控系统每天实时采集财务系统合并账务账套中的资产和负债数据，生成资产负债表，计算出净资产；	—
2、动态监控系统对采集的金融资产财务数据，利用资讯系统信息进行分类，并根据市价进行实时计算；	—
3、在系统生成净资本计算表的过程中，对不能由系统自动采集的或由于不可预料情况导致自动采集失败的数据，由财务会计部专人负责相关手工数据的及时准确录入，并保留录入数据来源的原始资料；	—
4、在系统生成风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表的过程中，对不能由系统自动采集的或由于不可预料情况导致自动采集失败的数据，由风险监管部专人负责相关手工数据的及时准确录入，并保留录入数据来源的原始资料；	—

5、在监控系统每天自动生成相关报表后，由风险监管部专人监控风险控制指标的变化，做好风险监控日志；	—
6、月末，净资本报表的生成由财务会计部负责，风险监管部负责复核，经财务会计部负责人签字确认后提交合规管理部对外报送。风险控制指标监管报表和风险资本准备报表的生成、复核由风险监管部负责并提交合规管理部对外报送。	—
第三十五条 为防止因数据录入错误导致相关风险控制指标计算出现较大误差，人工维护数据的录入、复核等规程，由财务会计部和风险监管部配合完成。	—
第三十六条 动态监控系统应为净资本计算表、风险控制指标监管报表、风险资本准备计算表及其项目的调整预留空间，以便能够做到根据监管部门发布的最新规定及时调整更新。	—
第三十七条 公司建立动态监控系统评估机制，由风险监管部牵头，信息技术部、财务会计部、合规管理部等部门参与，根据市场、业务发展、技术、监管环境的变化，在每季度末对动态监控系统的有效性进行评估，形成评估报告。	—
第六章 风险控制指标的 监控预警和报告机制	第五章 风险控制指标 报告机制
第三十八条 公司负责风险控制指标动态监控的人员应具备必要的专业知识和工作经验，能够 对各项业务的风险进行识别和判断。	—
第三十九条 根据业务状况和风险情况，公司	—

建立风险监控信息分级预警机制，在动态监控系统中设置了三级预警标准，分别为证监会规定的监管标准、预警标准和公司自行制定的关注标准。监管标准为不可触及的红线；预警标准为尽力回避的黄线；关注标准为合理关注的监控线。	
第四十条 公司建立风险监控信息报告制度，根据业务状况和风险情况，确定不同风险监控信息报告的内容、格式、报告频率、报告对象、处理程序等。风险监控信息报告分为常规报告和特别报告，报告中应明确风险等级、关键风险点、责任部门、责任人和风险处理建议，确保公司管理层能够及时获得真实、准确、完整的风险动态监控信息。	第二十四条 公司建立风险监控信息报告制度，根据业务状况和风险情况，确定不同风险监控信息报告的内容、格式、报告频率、报告对象、处理程序等。风险监控信息报告分为常规报告和特别报告，报告中应明确风险等级、关键风险点、责任部门、责任人和风险处理建议，确保公司管理层能够及时获得真实、准确、完整的风险动态监控信息。
第四十一条 公司风险监控信息报告实行四级报告制。 一级为风险控制指标处于关注标准以下，由风险监控部在风险监控工作月报中分析指标变化情况，报送公司相关领导和安徽证监局； 二级为风险控制指标处于预警标准与关注标准之间，需区分综合风险控制指标和单一业务风险控制指标采用不同的报告程序。 1、当综合风险控制指标处于预警标准与关注标准之间时，风险监控部应立即向合规总监报送特别报告并增加报告频率，由合规总监向风险控制委员会提交风险报告，以便公司采取措施调整业务规模和资产负债结构，提高净资本水平。 2、当单一业务风险控制指标处于预警标准与关注标准之间时，风险监控部需提示业务部门关注指标变动情况，要求业务部门拟定相关措施报风险监控部备案。是否向合规总监报告，由风险监控部	第二十五条 公司风险监控信息报告实行四级报告制。 一级为风险控制指标触及内部关注标准并处于预警标准以下，对于本办法中第 18 条规定的综合风险控制指标由风险监控部和资金计划部在风险监控工作月报或季报中报告指标触及内部关注标准，并分析指标变化情况及应对措施，报送公司相关领导；对于本办法中第 20、21 条规定的相关业务风险控制指标，由风险监控部以电话或电子邮件方式提示业务部门关注指标未来变动情况、做出应对方案。 二级为风险控制指标触及证监会规定的预警标准并处于内部监控标准以下，应按照以下程序进行报告： 1、当本办法中第 18 条规定的综合风险控制指标触及证监会规定的预警标准时，风险监控部和资金计划部应立即向首席风险官报送特别报告，并在

负责人根据风险状况确定，但在风险监控工作月报中需报告指标监控情况及处理结果。 三级为风险控制指标触及到预警标准时，公司应 按照监管部门要求，采取相关措施： 1、属综合风险控制指标触及到预警标准的，风险监控部应立即向合规总监、风险控制委员会报送特别报告，抄报董事会办公室；董事会应及时向公司董事会、公司主要股东书面报告，说明风险状况，提请采取相关措施，启动净资本补足机制。 2、属单一业务风险控制指标触及到预警标准的，风险监控部应立即向合规总监报告，并要求业务部门在2个工作日内，书面报告基本情况和问题成因以及拟采取解决问题的具体措施和期限。 3、在上述情形发生之日起3个工作日内，公司应向中国证监会及安徽证监局书面报告，说明基本情况和问题成因以及拟采取解决问题的具体措施和期限。 4、合规管理部增加对风险控制指标的检查频率，并提交有关风险控制指标水平的报告。 5、在风险控制指标未恢复预警标准以上，需向公司高管、董事会、公司主要股东每周书面报告一次监控情况。 四级为风险控制指标不符合监管标准时，公司应 按照监管部门的要求限期改正，在5个工作日内制定并报送整改计划，整改期限最长不超过20个工作日。	该情形发生之日起3个工作日内向安徽证监局报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。 2、当本办法中第20、21条规定的相关业务风险控制指标触及证监会规定的预警标准时，风险监控部应立即书面提示业务部门指标触及情况，并要求业务部门在1个工作日内，书面报告指标形成原因以及拟采取的具体措施。同时，风险监控部汇总业务部门提交的特别报告，向首席风险官、公司总裁报送，并在该情形发生之日起3个工作日内向安徽证监局报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。 3、原则上，公司所有的风险控制指标均不得超过证监会规定的预警标准，一旦超过，应采取措施使其恢复至预警标准以下。如果风险控制指标拟持续超出证监会规定的预警标准一定时间的，应征得首席风险官、分管领导、公司总裁批准。同时，在履行向安徽证监局报告义务后，各相关业务部门应做好应对方案，确保风险控制指标不触及证监会规定的监管标准，以免被中国证监会及其派出机构采取监管措施。风险监控部和资金计划部应加大监控力度，增加监测和报告频率。 三级为风险控制指标触及内部监控标准并超出时，风险监控部、资金计划部应立即向首席风险官、公司总裁、董事长报送特别报告，说明风险状况，提请采取控制业务规模、启动资本补足机制等相关措施，尽快将指标恢复至内部监控标准以下。在风险控制指标尚未恢复期间，风险监控部应向首席风险官、公司总裁、董事长每天书面报告一次风
---	--

	险控制指标监控情况。 四级为风险控制指标不符合证监会规定的监管标准时，公司应在该情形发生之日起1个工作日内，向公司领导报告，同时向安徽证监局报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。并按照监管部门的要求限期改正，在5个工作日内制定并报送整改计划，整改期限最长不超过20个工作日。
第四十二条 公司在对风险监控信息分级预警的同时，还对风险控制指标的变化比率进行监控。当净资本等风险控制指标与上月相比变化超过20%时，且变动前后均未触及预警指标的，可在月底将风控指标变动说明连同监管报表一并上报，并在风险监控工作月报中予以说明；若净资本等风险控制指标与上月相比变化超过20%时，且变动后的风控指标触及预警指标的，风险监控部应立即向合规总监报告，由合规总监根据风险状况确定是否向风险控制委员会提交风险报告，并在该情形发生之日起3个工作日内，向中国证监会及安徽证监局书面报告，说明基本情况和变化原因。	第二十六条 公司在对风险监控信息分级预警的同时，还对风险控制指标的变化比率进行监控。当净资本等风险控制指标与上月相比发生不利变化超过20%的，风险监控部、资金计划部应立即向首席风险官、公司总裁报告，由首席风险官根据风险状况确定是否向风控与合规委员会提交风险报告，并在该情形发生之日起3个工作日内，向中国证监会及安徽证监局报告，说明基本情况和变化原因。
第四十三条 公司实行风险控制指标监控档案制度，相关部门严格按照公司档案管理办法，妥善保管风险控制指标监控档案，监控档案包括但不限于风险监控日志、风险监控信息询证、人工数据调整记录、动态监控数据、动态监控报告及相关领导的批件、相关部门的回复、风险监控事项的处理及反馈、动态监控系统合规检查报告等。监控档案和风险控制指标数据分为电子和纸质两种，电子文件的保管期限至少应在5年以上，纸质文件的保管	—

期限至少应在 15 年以上。法律法规对相关数据的保存期限另有规定的，从其规定。	
第七章 净资本补足机制和风险控制指标分析测试	—
第四十四条 公司建立净资本补足机制，当净资本等各项风险控制指标达到证监会规定的预警标准时，公司将采用减少风险性较高的业务、投资品种或规模、追讨往来账项、转让长期股权投资、处置有形或无形资产、加大提取任意盈余公积、减少或暂停利润分配、发行次级债或债转股、募集资本金等方式补充净资本。	—
第四十五条 公司在开展以下业务（包括但不限于）前，业务部门应主动向风险监管部提交计划方案，由其对净资本和风险控制指标进行敏感性分析，并提出业务规模调整建议（分配利润前的敏感性分析由财务会计部负责）。 1、提交自营规模和自营业务风险限额议案； 2、在集合资产管理计划中投入自有资金； 3、签订包销协议； 4、新设分支机构； 5、报董事会审批的重大资产购置、重大投资、对外担保等事项； 6、新产品、新业务开展； 7、监管部门或公司认为必要的事项。	—
第四十六条 在全面防范风险的情况下，风险监管部应根据市场变化情况，对公司自身的风险承受能力适时进行压力测试，以度量在非正常的市场状态下公司各项风险控制指标的变化情况，衡量发生重大亏损对风险控制指标的影响程度，力求将风	—

险控制在可控范围。各相关业务部门应为风险监管部压力测试提供测算数据等各种支持。	
第八章 编制和披露	第六章 编制和披露
第四十七条 公司应当以母公司数据为基础，编制净资产计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表。	第二十七条 公司应当以母公司数据为基础，编制风险控制指标监管报表。
第四十八条 公司应当在每月结束之日起5个工作日内，由财务会计部和风险监管部制表、复核确认后，交由合规管理部向中国证监会及安徽证监局报送月度净资产计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表。	第二十八条 公司应当在每月结束之日起7个工作日内，由财务会计部、资金计划部和风险监管部制表、复核确认后，交由董事会办公室向中国证监会及安徽证监局报送月度风险控制指标监管报表。
第四十九条 公司月度净资产计算表由财务会计部负责人签署确认意见，月度风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表由风险监管部负责人签署确认意见。	第二十九条 公司月度净资产计算表、表内外资产总额计算表由财务会计部负责人签署确认意见，月度风险资本准备计算表和风险控制指标计算表由风险监管部负责人签署确认意见，流动性覆盖率计算表和净稳定资金率计算表由资金计划部负责人签署确认意见。最后，公司经营管理的主要负责人、首席风险官、财务负责人应在公司月度风险控制指标监管报表签署确认意见。公司董事、高级管理人员应当对公司半年度、年度风险控制指标监管报表签署确认意见。
第五十条 在净资产计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表上签字的人员，应当保证净资产计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏；对净资产计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表内容持有异议的，应当在报表上注明自己的意见和理由。	第三十条 在风险控制指标监管报表上签字的人员，应当保证风险控制指标监管报表真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏；对风险控制指标监管报表内容持有异议的，应当在报表上注明自己的意见和理由。

第五十一条 董事会办公室负责至少每半年经公司董事长和总裁签署确认后，向公司全体董事书面报告一次公司净资产等风险控制指标的具体情况和达标情况；负责至少每半年经董事会签署确认，向公司全体股东披露一次公司净资产等风险控制指标的具体情况和达标情况。 当净资产指标与上月相比发生30%以上变化或不符合规定标准时，董事会办公室应当在5个工作日内向公司全体董事书面报告，10个工作日内向公司全体股东披露。 上述向全体董事和全体股东报告的净资产等风险控制指标的具体情况、达标情况和变化情况，由风险监管部负责向董事会办公室提供。	第三十一条 董事会办公室负责至少每半年经公司董事长、总裁和首席风险官签署确认后，向公司全体董事报告一次公司净资产等风险控制指标的具体情况和达标情况；负责至少每半年经董事会签署确认，向公司全体股东报告一次公司净资产等风险控制指标的具体情况和达标情况，并至少获得主要股东的签收确认证明文件。 当净资产指标与上月相比发生20%以上不利变化或不符合规定标准时，风险监管部、资金计划部应在1个工作日内向董事会办公室书面报告，由董事会办公室在发生上述事实之日起5个工作日内向公司全体董事报告，10个工作日内向公司全体股东披露。 上述向全体董事和全体股东报告的净资产等风险控制指标的具体情况、达标情况和变化情况，由风险监管部、资金计划部负责向董事会办公室提供。
第九章 附则	第七章 附则
第五十二条 本办法下列用语的含义： （一）风险资本准备：证券公司开展各项业务、设立分支机构等存在可能导致净资产损失的风险，应当按一定标准计算风险资本准备并与净资产建立对应关系，确保各项风险资本准备有对应的净资产支撑。 （二）敏感性分析：指在保持其他条件不变的前提下，研究单个或者多个因素的变化对净资产等风险控制指标可能产生的影响，并判断是否会导致净资产等风险控制指标不符合预警标准或规定标准。	第三十二条 本办法下列用语的含义： （一）风险资本准备：证券公司在开展各项业务等过程中因市场风险、信用风险、操作风险等可能引起的非预期损失所需要的资本。公司应当按一定标准计算风险资本准备并与净资产建立对应关系，确保各项风险资本准备有对应的净资产支撑。 （二）负债：指对外负债，不含代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、代理承销证券款。 （三）资产：指自身资产，不含客户资产。 （四）或有负债：指过去的交易或者事项形成的潜在义务，其存在须通过未来不确定事项的发生

(三) 负债：指对外负债，不含代理买卖证券款。 (四) 资产：指自身资产，不含客户资产。 (五) 或有负债：指过去的交易或者事项形成的潜在义务，其存在须通过未来不确定事项的发生或者不发生予以证实；或过去的交易或者事项形成的现时义务，履行该义务不是很可能导致经济利益流出企业或该义务的金额不能可靠计量。 (六) 权益类证券：指股票、权证、股票型基金以及中国证监会规定的其他证券。 (七) 固定收益类证券：指政府债券、公司债券、债券型基金以及中国证监会规定的其他证券。 (八) 存出保证金：指证券公司因办理业务需要存出或交纳的各种保证金款项。	或者不发生予以证实；或过去的交易或者事项形成的现时义务，履行该义务不是很可能导致经济利益流出企业或该义务的金额不能可靠计量。 (五) 表内外资产总额：表内资产余额与表外项目余额之和。
第五十三条 公司相关部门可以依据本办法制订具体的实施细则或工作规程。	第三十三条 公司相关部门可以依据本办法制订具体的实施细则或工作规程。
第五十四条 本办法自公司董事会审议通过后发布。	第三十四条 本办法自公司董事会审议通过之日起执行。
第五十五条 本办法解释权属公司董事会。	第三十五条 本办法解释权属公司董事会。

修订后的《国元证券股份有限公司风险控制指标管理办法》见巨潮资讯网
(www.cninfo.com.cn)。

特此公告。

国元证券股份有限公司董事会

2017 年 6 月 17 日