

# 方正证券股份有限公司

## 2019 年上半年风险控制指标情况报告

2019 年上半年，方正证券股份有限公司（以下简称“公司”）根据《证券公司风险控制指标管理办法》及《证券公司全面风险管理规范》等相关制度的规定，持续完善以净资本为核心的风险控制指标管理体系，通过动态监控净资本和流动性等各项风险控制指标（以下简称“风控指标”）、定期与不定期开展压力测试等方式进行风控指标管理，通过积极拓宽融资渠道、调整资产负债结构、优化资源配置、留存收益等方式，保障公司经营发展与风控指标的承受能力相匹配。现将公司 2019 年上半年风控指标有关情况报告如下：

### 一、报告期内风控指标监控情况

公司定期向监管部门报送证券公司风控指标计算表，风控指标监控异常时须报送临时报告。报告期内，公司财务管理部按月编制公司净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表和风控指标计算表，经风险管理部复核后交由董事会办公室报出；公司风险管理部按月编制并内部交叉复核流动性覆盖率计算表和净稳定资金率计算表后，交由董事会办公室报出。

报告期内，公司通过监控系统等对风控指标进行持续动态监控。当风控指标达到中国证监会规定的预警标准或不符合规定标准时，公司均已按监管要求向公司注册地的中国证监会派出机构书面报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。对风控指标与上月相比发生不利变化超过 20%的情况，公司也已按时向监管部门报送了书面报告。

公司将压力测试作为风控指标事前控制的重要工具，根据监管要求、公司内部经营管理需要对风控指标开展压力测试，评估风控指标的承压情况，评估结果作为公司决策重要依据。

### 二、报告期内风控指标达标情况

报告期内，净资本、流动性等各项主要风控指标均持续符合监管标准。

2019年上半年公司净资本、流动性等主要风控指标具体情况如下：

风控指标	1月末	2月末	3月末	4月末	5月末	6月末	预警标准	监管标准
净资产（亿元）	374.51	374.66	380.70	381.13	382.29	379.22	--	--
净资本（亿元）	172.03	172.96	180.20	178.59	180.73	174.44	≥2.4	≥2
风险覆盖率（%）	194.76	197.55	201.87	193.86	200.17	190.93	≥120	≥100
资本杠杆率（%）	16.02	16.65	17.17	16.41	16.61	14.97	≥9.6	≥8
流动性覆盖率（%）	200.40	380.50	236.47	377.04	308.37	268.23	≥120	≥100
净稳定资金率（%）	116.18	117.51	118.61	120.94	117.28	123.33	≥120	≥100
净资本/净资产（%）	45.94	46.16	47.33	46.86	47.27	46.00	≥24	≥20
净资本/负债（%）	28.79	30.80	31.85	29.89	30.35	26.25	≥9.6	≥8
净资产/负债（%）	62.68	66.73	67.28	63.79	64.20	57.06	≥12	≥10
自营权益类证券及其	35.08	38.24	36.66	37.45	35.05	39.37	≤80	≤100
自营非权益类证券及其衍生品/净资本（%）	224.26	195.32	201.73	216.00	222.82	250.06	≤400	≤500
融资（含融券）业务规模与净资本的比例	120.10	126.83	132.94	137.05	130.04	128.92	≤320	≤400

报告期内，公司净稳定资金率指标发生4次低于监管预警标准但高于监管标准的情形，主要原因有两个，一是根据公司与子公司民族证券的业务整合方案，2019年1月，民族证券将与经纪、信用业务相关的资产、负债全部转移至公司，公司所需稳定资金增加；二是公司长期负债规模阶段性减少。公司通过发行长期负债、融入转融资、适当控制业务规模等措施提升指标，同时公司积极与监管部门沟通持续推动民族减资工作。

报告期内，公司作为主做市商为一只权益类基金提供主流流动性服务，做市期间公司持有该只基金的规模与其总规模的比例超过4%，导致“持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例”超过监管预警标准1次，公司于发现当日将指标降为监管预警标准之下。因公司作为主做市商为该基金提供流动性服务，按照相关监管要求对其集中度指标超标情况可以予以豁免。

报告期内，公司持有一只资产管理计划的规模与其总规模的比例超过16%，

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 1 次，公司已于发现当日将指标降为监管预警标准之下。

2017 年 7 月，公司持有一只信托产品的规模与其总规模的比例超过 16%，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，该信托产品到期时间为 2019 年 7 月 18 日，产品存续期内，公司持有比例维持不变，不会超过监管标准。

当公司净资本、流动性或其他风控指标达到中国证监会规定的预警标准或不符合规定标准时，公司已按监管要求向公司注册地的中国证监会派出机构书面报告，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。截至 2019 年 6 月末，公司净资本、流动性等各项主要风控指标均符合监管预警标准。

### **三、报告期内资本补足情况**

报告期内公司资本比较充足，未出现需要补足资本的情形。

方正证券股份有限公司  
2019 年 8 月 19 日