

国海证券股份有限公司

2018年中期风险控制指标报告

2018年上半年，国海证券股份有限公司（以下简称公司）严格落实《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》等法规及自律规则要求，动态监控净资本等风险控制指标，认真开展敏感性分析和压力测试工作，确保净资本等各项风险控制指标持续符合规定标准。

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

项目	2018年6月30日 (未经审计)	2017年12月31日 (经审计)
核心净资本	11,059,369,614.22	11,261,946,093.85
附属净资本	4,119,581,509.92	3,392,925,344.93
净资本	15,178,951,124.14	14,654,871,438.78
净资产	13,181,752,184.10	13,397,211,753.08
各项风险资本准备之和	5,973,225,087.92	5,932,035,919.10
表内外资产总额	54,138,237,969.96	53,852,255,529.03
风险覆盖率	254.12%	247.05%
资本杠杆率	20.43%	20.91%
流动性覆盖率	283.33%	303.41%
净稳定资金率	198.86%	153.83%
净资本/净资产	115.15%	109.39%
净资本/负债	37.38%	36.55%
净资产/负债	32.46%	33.41%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	7.12%	7.72%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	221.29%	231.17%

（二）公司风险控制指标达标情况。

在报告期内，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，未发生超过监管标准的情况。

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实时计量、动态监控和及时预警，按照规定开展敏感性分析和压力测试工作，并根据监控情况及压力测试结果及时采取有效措施，确保净资本各项风险控制指标持续符合规定标准。

三、净资本补足机制建立情况

公司制定了《国海证券股份有限公司流动性风险管理办法》，建立了净资本补足机制，公司净资本等风险控制指标达到预警标准或之前，公司将采用以下一种或多种措施确保净资本等各项风险控制指标持续符合要求：

1. 通过公开发行股票（配股、增发）、非公开发行股票等方式直接提高净资产；
2. 通过发行证券公司次级债券等方式补充净资本；
3. 通过转让长期股权投资、处置有形或无形资产等方式调整资产结构，减少资产项目的风险调整以增加净资本；

4. 通过降低占用风险资本准备较高的投资或业务规模、催收应收账款（如有）等方式降低公司各项风险资本准备。

国海证券股份有限公司
二〇一八年八月二十三日