

国海证券股份有限公司

2013年中期风险控制指标情况报告

2013 年上半年，国海证券股份有限公司（以下简称“本公司或公司”）切实贯彻监管要求，动态监控净资本等风险控制指标，全面开展净资本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，本公司风险控制指标具体情况如下：

项目	2013年6月30日 (未经审计)	2012年12月31日 (经审计)
净资本（元）	2,577,017,248.09	2,163,917,537.71
净资产（元）	2,705,550,900.65	2,590,288,150.97
净资本/各项风险资本准备之和	437.59%	356.39%
净资本/净资产	95.25%	83.54%
净资本/负债	99.13%	116.00%
净资产/负债	104.07%	138.86%
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本	3.80%	1.85%
自营固定收益类证券/净资本	91.44%	125.10%

（二）报告期内，本公司风险控制指标达标情况

报告期内，本公司以净资本为核心的各项风险控制指标均持续符合监管标准，没有发生触及监管标准的情况。

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，公司不仅利用风险控制指标动态监控系统实现风险控制指标准确计量、动态监控和及时预警的管理目标，还据此开展了相关分析测试工作。为保障监控体系有效运行，公司合规部、计划财务部相互配合，设立专人专岗，对风险控制指标进行动态监控，及时掌握风险控制指标的变动情况。每月末，公司按照监管要求及时向监管机构上报月度净资本计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表。当出现净资本等风险控制指标与上月相比变化超过20%、对单一客户融资规模与净资本的比例超过预警标准的情形时，公司按规定及时向监管机构报告，说明基本情况及应对措施。公司风险控制指标动态监控机制，能够及时监控以净资本为核心的各项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在任一时点都符合监管要求。

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

二〇一三年七月二十五日