

国海证券股份有限公司

2017年度风险控制指标情况报告

2017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	2017年12月31日 (经审计)	2016年12月31日 (经审计)
核心净资本(元)	11,261,946,093.85	11,357,466,277.90
附属净资本(元)	3,392,925,344.93	1,999,944,235.40
净资本(元)	14,654,871,438.78	13,357,410,513.30
净资产(元)	13,397,211,753.08	13,486,631,087.03
各项风险资本准备之和 (元)	5,932,035,919.10	5,363,051,129.08
表内外资产总额(元)	53,852,255,529.03	53,537,834,329.16
风险覆盖率	247.05%	249.06%
资本杠杆率	20.91%	21.21%
流动性覆盖率	303.41%	226.32%
净稳定资金率	153.83%	144.65%
净资本/净资产	109.39%	99.04%
净资本/负债	36.55%	33.58%
净资产/负债	33.41%	33.91%

自营权益类证券及其衍生品/净资本	7.72%	1.94%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	231.17%	238.40%

（二）公司风险控制指标达标情况

在报告期内，受集合资产管理计划规模变动、债券回售等影响，导致公司“持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例”的风险控制指标超过监管标准，公司已及时采取措施，将上述风险控制指标降至监管预警标准之下，并向监管部门报告。

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

公司建立了净资本补足机制，若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品种或规

模、追讨往来款项、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规定标准。

国海证券股份有限公司

二〇一八年四月十九日