

方正证券股份有限公司

关于 2019 年度风险控制指标相关情况的报告

方正证券股份有限公司全体股东：

根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》的相关规定，现将公司 2019 年度风险控制指标相关情况报告如下：

一、净资本等风险控制指标具体情况

单位：元，人民币

项目	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
净资本	20,903,236,065.74	17,724,161,078.92
净资产	38,501,756,893.55	37,405,880,877.76
风险覆盖率（%）	259.00	186.60
资本杠杆率（%）	23.49	16.24
流动性覆盖率（%）	221.52	479.01
净稳定资金率（%）	130.45	122.07
净资本/净资产（%）	54.29	47.38
净资本/负债（%）	42.83	29.77
净资产/负债（%）	78.88	62.84
自营权益类证券及其衍生品/净资本（%）	32.41	33.83
自营非权益类证券及其衍生品/净资本（%）	175.42	258.44
各项风险资本准备之和	8,070,708,318.68	9,498,247,611.96

二、净资本等风险控制指标达标情况

报告期内，公司净资本、流动性等各项主要风险控制指标均持续符合监管标准。

因对子公司（方正证券承销保荐有限责任公司）减资过程中资产交割基准日与减少对子公司出资获批日不同、长期负债规模阶段性减少等原因，2019 年公司净稳定资金率出现 5 次低于监管预警标准的情况，但未出现低于监管标准的情况，公司采取融入长期资金、合理控制业务规模等措施改善指标。

报告期内，当公司净资本、流动性或其他风险控制指标达到中国证监会规定

的预警标准时，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 12 月末，公司净资本、流动性等各项主要风险控制指标均符合监管标准。

三、资本补足情况

2019 年公司通过发行长期次级债、净利润留存等补充净资本，公司全年累计发行 2 年期次级债 15.6 亿元。因完成对子公司（方正证券承销保荐有限责任公司）减资，公司的净资本也得到较大规模提升。2019 年 12 月末公司净资本为 209.03 亿元。

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

2020 年 4 月 24 日