

东兴证券股份有限公司

风险控制指标监管报表专项审计报告
2019年12月31日

2019年12月31日

<u>内容</u>	<u>页码</u>
审计报告	1 - 2
证券公司净资本计算表	3
证券公司风险资本准备计算表	4 - 5
证券公司表内外资产总额计算表	6
证券公司流动性覆盖率计算表	7 - 8
证券公司净稳定资金率计算表	9 - 10
证券公司风险控制指标计算表	11 - 12
风险控制指标监管报表附注	13

审计报告

德师报(审)字(20)第 S00180 号
(第 1 页, 共 2 页)

东兴证券股份有限公司董事会:

一、审计意见

我们审计了东兴证券股份有限公司(以下简称“东兴证券”)的风险控制指标监管报表,包括 2019 年 12 月 31 日的净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表和风险控制指标监管报表以及相关附注。

我们认为,后附的风险控制指标监管报表在所有重大方面按照风险控制指标监管报表附注二所述编制基础编制。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对风险控制指标监管报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东兴证券,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、编制基础以及对分发和使用的限制

我们提醒风险控制指标监管报表使用者关注风险控制指标监管报表附注二对编制基础的说明。东兴证券风险控制指标监管报表仅为满足证券监管机构监管要求之目的而编制,因此该风险控制指标监管报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于上述目的,不得用于其他任何目的。本段内容不影响已发表的审计意见。

四、管理层和治理层对风险控制指标监管报表的责任

东兴证券管理层负责按照风险控制指标监管报表附注二所述编制基础编制风险控制指标监管报表,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使风险控制指标监管报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

治理层负责监督东兴证券的风险控制指标监管报表报告过程。



因我不同

成就不凡

始于 1845

五、注册会计师对风险控制指标监管报表审计的责任

我们的目标是对风险控制指标监管报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响风险控制指标监管报表使用者依据风险控制指标监管报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的风险控制指标监管报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 评价风险控制指标监管报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价风险控制指标监管报表是否按照风险控制指标监管报表附注二所述编制基础编制。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明, 并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项, 以及相关的防范措施(如适用)。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

中国·上海



中国注册会计师: 李 燕



中国注册会计师: 邱 丽



2020 年 4 月 28 日



证券公司净资本计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初余额	期末余额	扣减比例	应计算的金额	
					期初余额	期末余额
净资产	1	19,271,380,491.95	20,005,517,279.43		19,271,380,491.95	20,005,517,279.43
减：优先股及永续次级债等	2	-	-	100%	-	-
减：资产项目的风险调整合计	3	4,055,498,036.39	4,316,142,932.98		3,862,017,164.11	4,220,327,695.30
存出保证金	4	270,899,451.98	112,862,831.68		77,418,579.70	17,047,594.00
其中：履约保证金	5	-	-	10%	-	-
期货保证金	6	72,418,579.70	7,047,594.00	100%	72,418,579.70	7,047,594.00
其他存出保证金	7	5,000,000.00	10,000,000.00	100%	5,000,000.00	10,000,000.00
长期股权投资	8	3,037,416,292.82	3,494,015,781.54	100%	3,037,416,292.82	3,494,015,781.54
投资性房地产、固定资产	9	205,752,064.81	187,722,767.99	100%	205,752,064.81	187,722,767.99
其他	10	541,430,226.78	521,541,551.77	100%	541,430,226.78	521,541,551.77
减：或有负债的风险调整合计	11	-	564,970,932.56		-	564,970,932.56
对外担保金额及担保承诺	12	-	-	100%	-	-
其他或有负债	13	-	564,970,932.56	100%	-	564,970,932.56
加：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计	14	-	-		-	-
母公司提供的担保承诺	15	-	-	100%	-	-
其他项目	16	-	-		-	-
减：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计	17	-	-		-	-
所有权受限等无法变现的资产(如被冻结)	18	-	-	100%	-	-
其他项目	19	-	-		-	-
核心净资本	20				15,409,363,327.84	15,220,218,651.57
加：附属净资本	21	5,000,000,000.00	5,000,000,000.00		1,500,000,000.00	1,400,000,000.00
借入的次级债(含永续次级债)	22	5,000,000,000.00	5,000,000,000.00		1,500,000,000.00	1,400,000,000.00
中国证监会认定或核准的其他调整项目	23	-	-		-	-
净资本	24				16,909,363,327.84	16,620,218,651.57

第3页至第13页的监管报表及附注由下列负责人签署：

法定代表人

财务负责人

首席风险官

证券公司风险资本准备计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准(基准)	风险资本准备	
					期初余额	期末余额
1.市场风险资本准备	1	33,954,351,017.07	34,483,196,801.83		4,942,195,476.41	5,689,400,440.42
其中：(1)权益类证券及其衍生品规模	2	4,190,201,811.05	5,112,563,422.68		1,098,194,494.26	1,094,575,854.50
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	3	1,400,954,841.66	2,426,015,253.78	15%	210,143,226.25	363,902,288.07
一般上市股票	4	2,201,165,303.46	2,264,523,550.20	30%	660,349,591.04	679,357,065.06
流通受限的股票	5	209,726,792.12	418,845.20	50%	104,863,396.06	209,422.60
其他股票	6	111,280,965.44	142.00	80%	89,024,772.35	113.60
权益类基金	7	196,012,731.15	332,560,202.19	10%	19,601,273.12	33,256,020.22
其中：分级基金中的非优先级基金	8	-	-	30%	-	-
股指期货、权益互换及卖出期权	9	71,061,177.22	88,993,105.45	20%	14,212,235.44	17,798,621.09
买入期权	10	-	52,323.86	100%	-	52,323.86
其他	11	-	-		-	-
(2)非权益类证券及其衍生品规模	12	29,713,301,251.67	29,370,633,379.15		3,841,458,584.43	4,594,824,585.92
国债、中央银行票据、国开债	13	358,778,549.73	873,015,496.58	0%	-	-
政策性金融债、政府支持机构债券	14	52,934,246.57	179,651,262.61	2%	1,058,684.93	3,593,025.25
地方政府债	15	8,147,835,943.66	4,956,940,286.71	5%	407,391,797.18	247,847,014.34
信用评级AAA级的信用债券	16	4,303,125,306.01	4,582,770,821.78	10%	430,312,530.60	458,277,082.18
信用评级AAA级以下，AA级(含)以上的信用债券	17	8,354,186,974.86	11,949,471,539.72	15%	1,253,128,046.23	1,792,420,730.96
信用评级AA级以下，BBB级(含)以上的信用债券	18	237,566,859.70	119,060,899.65	50%	118,783,429.85	59,530,449.83
信用评级BBB级以下的信用债券	19	-	482,156,095.89	80%	-	385,724,876.71
非权益类基金	20	1,105,836,061.19	479,692,110.05	10%	110,583,606.12	47,969,211.01
其中：货币基金	21	3,290,578,096.03	1,914,751,458.21	5%	164,528,904.80	95,737,572.91
国债期货、债券远期及利率互换	22	4,088,550.00	14,400,000.00	20%	817,710.00	2,880,000.00
集合及信托等产品	23	2,233,531,047.66	2,446,347,248.91		802,124,244.76	850,231,271.01
其中：未约定先行承担亏损	24	1,258,565,116.29	1,491,769,413.82	25%	314,641,279.07	372,942,353.46
约定先行承担亏损	25	974,965,931.37	954,577,835.09	50%	487,482,965.69	477,288,917.55
定向产品	26	1,062,996,689.01	1,299,754,733.04	50%	531,498,344.51	649,877,366.52
大宗商品现货(含黄金)	27	-	-	8%	-	-
大宗商品衍生品	28	82,172,927.25	51,426.00	20%	16,434,585.45	10,285.20
其他	29	479,670,000.00	72,570,000.00	1%	4,796,700.00	725,700.00
(3)已对冲风险的权益类证券及其衍生品	30	50,847,954.35	-		2,542,397.72	-
权益类证券	31	29,546,864.00	-	5%	1,477,343.20	-
权益类衍生品	32	21,301,090.35	-	5%	1,065,054.52	-
(4)已对冲风险的非权益类证券及其衍生品	33	-	-		-	-
非权益类证券	34	-	-	1%	-	-
非权益类衍生品	35	-	-	1%	-	-

证券公司风险资本准备计算表 - 续

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准(基准)	风险资本准备	
					期初余额	期末余额
2.信用风险资本准备	36	16,718,937,458.63	17,582,697,528.93		2,693,917,703.44	2,538,851,266.58
融资类业务	37	14,935,059,294.57	16,868,161,420.20		2,278,786,683.42	2,112,133,312.38
其中：场内融资业务	38	7,082,251,754.90	12,614,989,716.65	10%	708,225,175.49	1,261,498,971.67
其中：股票质押回购	39	7,852,807,539.67	4,253,171,703.55	20%	1,570,561,507.93	850,634,340.71
场外融资业务	40	-	-	30%	-	-
应收账款	41	1,783,878,164.06	714,536,108.73		415,131,020.02	426,717,954.20
其中：账龄一年以内(含一年)	42	1,520,830,160.04	319,797,949.48	10%	152,083,016.00	31,979,794.95
账龄一年以上、应收股东及其关联公司款项	43	263,048,004.02	394,738,159.25	100%	263,048,004.02	394,738,159.25
其他	44	-	-		-	-
3.操作风险资本准备	45	3,315,741,840.11	3,339,526,296.93		511,291,029.77	516,299,870.54
证券经纪业务净收入	46	793,021,843.57	758,359,434.02	12%	95,162,621.23	91,003,132.08
证券投资咨询业务净收入	47	18,876,912.20	18,623,032.99	12%	2,265,229.46	2,234,763.96
证券承销与保荐业务、财务顾问业务净收入	48	688,699,124.72	760,286,644.35	15%	103,304,868.71	114,042,996.65
证券资产管理业务净收入	49	538,920,078.74	512,910,518.41	15%	80,838,011.81	76,936,577.76
证券自营业务净收入	50	1,137,696,094.46	957,690,478.01	18%	204,785,297.00	172,384,286.04
融资类业务及其他业务净收入	51	138,527,786.42	331,656,189.15	18%	24,935,001.56	59,698,114.05
4.特定风险资本准备	52	110,997,804,339.75	105,597,296,668.35		623,944,990.83	467,150,096.83
证券公司资产管理业务	53	110,997,804,339.75	105,597,296,668.35		487,236,557.15	351,531,057.28
其中：结构化集合资管计划	54	4,512,769,886.07	4,335,154,909.79	1%	45,127,698.86	43,351,549.10
投资非标资产的定向资管计划	55	26,764,572,615.33	14,737,200,161.83	0.9%	240,881,153.54	132,634,801.46
各类私募投资基金(含各类直投基金)	56	1,845,048,739.92	1,777,000,000.00	0.7%	12,915,341.18	12,439,000.00
其他定向资管计划	57	37,662,472,714.97	32,621,141,344.25	0.5%	188,312,363.57	163,105,706.72
参与股票质押回购的资产管理业务		9,113,895,578.89	7,707,935,969.96	1.50%	136,708,433.68	115,619,039.55
其中：集合资管计划		1,597,546,647.50	2,201,129,507.44	1.50%	23,963,199.71	33,016,942.61
定向资管计划		7,516,348,931.39	5,506,806,462.52	1.50%	112,745,233.97	82,602,096.94
专项资管计划		-	-	1.50%	-	-
分类调整前的各项风险资本准备合计	58				8,771,349,200.45	9,211,701,674.37
分类调整后的各项风险资本准备合计	59				7,017,079,360.36	7,369,361,339.50

证券公司表内外资产总额计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目		行次	期末	转换系数	计算结果
表内资产	表内资产总额	1	66,048,354,687.31	100%	66,048,354,687.31
	减：表内资产扣除项	2	8,870,102,246.36		8,870,102,246.36
	1.客户资金	3	8,870,102,246.36		8,870,102,246.36
	代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、代理承销证券款	4	8,818,760,903.51	100%	8,818,760,903.51
	其它	5	51,341,342.85	100%	51,341,342.85
	表内资产余额	6	57,178,252,440.95		57,178,252,440.95
表外项目	1.证券衍生产品	7	103,444,531.45		103,444,531.45
	国债期货、债券远期及利率互换	8	14,400,000.00	100%	14,400,000.00
	股指期货、权益互换及卖出股票期权	9	12,079,166.75	100%	12,079,166.75
	大宗商品衍生品	10	51,426.00	100%	51,426.00
	卖出场外期权	11	76,913,938.70	100%	76,913,938.70
	其他	12	-		-
	2.资产管理业务	13	105,597,296,668.35	0.2%	211,194,593.34
	3.其他表外项目	14	9,204,620,152.56		999,110,854.56
	转融通融入证券	15	43,149,220.00	10%	4,314,922.00
	股票再融资承销承诺	16	-	15%	-
	股票IPO承销承诺	17	-	10%	-
	债券承销承诺	18	8,596,500,000.00	5%	429,825,000.00
	对外担保金额及担保承诺	19	-	100%	-
	其它或有事项	20	564,970,932.56	100%	564,970,932.56
	表外项目余额	21	114,905,361,352.36		1,313,749,979.35
	表内外资产总额	22	172,083,613,793.31		58,492,002,420.30

证券公司流动性覆盖率计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期末金额	折算率	折算后金额
优质流动性资产	1	18,407,574,664.82		15,153,976,865.31
其中：货币资金	2	474,945,207.16	100%	474,945,207.16
结算备付金	3	295,089,446.77	100%	295,089,446.77
国债、中央银行票据、国开债	4	873,015,496.58	100%	873,015,496.58
减：已冻结或质押部分	5	-	100%	-
政策性金融债券、政府支持机构债券	6	179,651,262.61	98%	176,058,237.36
减：已冻结或质押部分	7	157,616,103.43	98%	154,463,781.36
地方政府债	8	4,956,940,286.71	95%	4,709,093,272.37
减：已冻结或质押部分	9	3,236,672,932.73	95%	3,074,839,286.09
信用评级 AAA 级的信用债券	10	3,976,143,476.14	96%	3,817,097,737.09
减：已冻结或质押部分	11	1,934,284,545.34	96%	1,856,913,163.53
信用评级 AAA 级以下，AA 级(含)以上的信用债券	12	11,705,564,690.27	90%	10,535,008,221.24
减：已冻结或质押部分	13	3,065,968,331.90	90%	2,759,371,498.71
货币基金	14	1,914,751,458.20	60%	1,148,850,874.92
上海 180 指数、深圳 100 指数、沪深 300 指数 ETF 及成分股	15	2,426,015,253.78	40%	970,406,101.51
减：已冻结或质押部分	16	-	40%	-
未来 30 日现金流出	17	26,075,991,214.57		1,718,296,452.43
1.30 日内到期的负债现金流出	18	8,214,961,567.56		768,890,480.88
短期借款	19	-	100%	-
拆入资金	20	50,000,000.00	100%	50,000,000.00
卖出回购(按质押物分类)	21	7,889,731,558.31		443,660,471.63
其中：国债、中央银行票据、国开债	22	429,410,000.70	0%	-
政策性金融债券、政府支持机构债券	23	408,249,601.37	2%	8,164,992.03
地方政府债	24	3,105,738,929.59	5%	155,286,946.48
信用评级 AAA 级的信用债券	25	1,907,079,492.48	4%	76,283,179.70
信用评级 AAA 级以下，AA 级(含)以上的信用债券	26	2,039,253,534.17	10%	203,925,353.42
债券基金	27	-	10%	-
其他	28	-	100%	-
应付职工薪酬、税费、利息和股利	29	167,061,234.31	100%	167,061,234.31
交易性金融负债、衍生金融负债	30	43,105,617.15	100%	43,105,617.15
30 日内须偿还的次级债务和其他债务	31	65,063,157.79	100%	65,063,157.79
2.或有负债	32	-		-
对外担保金额及担保承诺	33	-	3%	-
其他或有事项	34	-	3%	-

证券公司流动性覆盖率计算表 - 续

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期末金额	折算率	折算后金额
3.自营业务及长期投资资金流出	35	1,014,721,319.28		107,090,555.16
利率互换	36	481,685,397.50	0.1%	483,370.80
国债期货及债券远期	37	-	4%	-
股指期货	38	533,035,921.78	20%	106,607,184.36
已承诺不可撤销的30日内须支付的自营业务投资金额	39	-	100%	-
已承诺不可撤销的30日内须支付的长期股权、 固定资产、无形资产和其他长期资产的投资金额	40	-	100%	-
4.承销业务资金流出	41	-		-
股票再融资承销承诺	42	-	15%	-
股票IPO承销承诺	43	-	10%	-
债券承销承诺	44	-	5%	-
5.融资类业务资金流出	45	16,846,308,327.73	5%	842,315,416.39
6.资产管理业务资金流出	46	-		-
已承诺不可撤销的30日内须自有资金认购的金额	47	-	100%	-
7.其他资金流出	48	-		-
已承诺不可撤销的30日内须给付的约定购回业务金额	49	-	100%	-
未来30日现金流入	50	72,570,000.00		65,313,000.00
1.30日内到期的短期资金流入	51	72,570,000.00		65,313,000.00
银行承兑汇票	52	-	100%	-
拆出资金	53	-	50%	-
买入返售金融资产	54	72,570,000.00	90%	65,313,000.00
应收股利、应收利息	55	-	50%	-
2.自营业务资金流入	56	-		-
30日内到期的信用评级AA级以下(不含)的信用债券	57	-	75%	-
3.未使用的不可撤销金融机构授信额度	58	-	75%	-
4.其他资金流入	59	-		-
集中清算交易在途结算资金	60	-	50%	-
银行间市场非集中清算交易在途结算资金	61	-	40%	-
未来30日内现金净流出	62	-		1,652,983,452.43
流动性覆盖率(LCR)	63			916.77%

证券公司净稳定资金率计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期末金额	折算率	折算后金额
可用稳定资金	1	57,178,252,440.95		33,775,594,577.36
其中：1.净资产	2	20,005,517,279.43	100%	20,005,517,279.43
2.剩余存续期大于等于1年的借款和负债	3	13,770,077,297.93		13,770,077,297.93
次级债务	4	2,051,379,322.83	100%	2,051,379,322.83
长期借款	5	-	100%	-
应付债券	6	11,718,697,975.10	100%	11,718,697,975.10
其他	7	-	100%	-
3.所有其他负债和权益	8	23,402,657,863.59	0%	-
所需稳定资金	9	58,763,535,686.27		21,560,852,827.66
其中：1.高流动性资产	10	2,870,218,943.81		-
货币资金	11	474,945,207.16	0%	-
结算备付金	12	295,089,446.77	0%	-
拆出资金(不足1年)	13	-	0%	-
存出保证金	14	112,862,831.68	0%	-
买入返售金融资产	15	72,570,000.00	0%	-
货币基金	16	1,914,751,458.20	0%	-
2.剩余存续期不足1年的证券	17	9,183,927,103.22		49,561,162.55
国债、中央银行票据、国开债	18	-	0%	-
政策性金融债、政府支持机构债券	19	-	0%	-
地方政府债	20	4,956,940,286.71	0%	-
信用评级AAA级的信用债券	21	1,217,561,406.30	0%	-
信用评级AAA级以下,AA级(含)以上的信用债券	22	2,516,242,083.16	1%	25,162,420.83
信用评级AA级以下,BBB级(含)以上的信用债券	23	13,021,231.16	3%	390,636.93
信用评级BBB级以下的信用债券	24	480,162,095.89	5%	24,008,104.79
3.剩余存续期大于等于1年证券	25	13,853,464,443.96		2,296,244,625.14
国债、中央银行票据、国开债	26	873,015,496.58	5%	43,650,774.83
政策性金融债、政府支持机构债券	27	179,651,262.61	5%	8,982,563.13
地方政府债	28	-	5%	-
信用评级AAA级的信用债券	29	3,271,522,166.27	10%	327,152,216.63
信用评级AAA级以下,AA级(含)以上的信用债券	30	9,423,235,850.01	20%	1,884,647,170.00
信用评级AA级以下,BBB级(含)以上的信用债券	31	106,039,668.49	30%	31,811,900.55
信用评级BBB级以下的信用债券	32	-	50%	-
4.股票	33	4,690,957,649.18		1,860,485,196.43
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	34	2,426,015,253.78	30%	727,804,576.13
一般上市股票	35	2,264,523,550.20	50%	1,132,261,775.10
流通受限的股票及其他股票	36	418,845.20	100%	418,845.20
5.可转换债券	37	103,680,855.76	30%	31,104,256.73
6.衍生金融资产	38	5,590,993.48	0%	-
7.证券投资基金	39	812,252,312.24		114,481,251.45
非权益类基金	40	479,692,110.05	10%	47,969,211.01
权益类基金	41	332,560,202.19	20%	66,512,040.44
其中：分级基金中非优先级基金	42	-	50%	-
8.其他现金管理类资产	43	-	20%	-

证券公司净稳定资金率计算表 - 续

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期末金额	折算率	折算后金额
9.融出资金	44	12,593,136,624.18		6,274,068,312.09
自有资金融出资金	45	12,543,136,624.18	50%	6,271,568,312.09
转融通融出资金	46	50,000,000.00	5%	2,500,000.00
10.约定购回融出资金	47	-	50%	-
11.股票质押式回购融出资金	48	4,253,171,703.55		2,256,910,851.78
到期日在1年以内(含)的融出资金	49	3,731,871,703.55	50%	1,865,935,851.78
到期日在1年以上(不含)的融出资金	50	521,300,000.00	75%	390,975,000.00
12.1年以内的应收款项、应收股利、应收利息	51	468,150,689.57	50%	234,075,344.79
13.其他所有资产	52	8,349,292,115.48	100%	8,349,292,115.48
14.表外项目	53	1,579,692,251.84		94,629,711.22
14.1 证券衍生产品	54	1,014,721,319.28		66,381,164.59
利率互换	55	481,685,397.50	0.5%	2,416,853.98
国债期货及债券远期	56	-	3%	-
股指期货	57	533,035,921.78	12%	63,964,310.61
14.2 其他表外项目	58	564,970,932.56		28,248,546.63
股票再融资承销承诺	59	-	15%	-
股票IPO承销承诺	60	-	10%	-
债券承销承诺	61	-	5%	-
对外担保金额及担保承诺	62	-	5%	-
其他或有事项	63	564,970,932.56	5%	28,248,546.63
净稳定资金率(NSFR)	64			156.65%

证券公司风险控制指标计算表

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
核心净资本	1	15,409,363,327.84	15,220,218,651.57	\	\	
附属净资本	2	1,500,000,000.00	1,400,000,000.00	\	\	
净资本	3	16,909,363,327.84	16,620,218,651.57	\	\	
净资产	4	19,271,380,491.95	20,005,517,279.43	\	\	
各项风险资本准备之和	5	7,017,079,360.36	7,369,361,339.50	\	\	
表内外资产总额	6	57,381,297,665.76	58,492,002,420.30	\	\	
风险覆盖率	7	240.97%	225.53%	≥120%	≥100%	
资本杠杆率	8	26.85%	26.99%	≥9.6%	≥8%	
流动性覆盖率	9	207.03%	916.77%	≥120%	≥100%	
净稳定资金率	10	177.01%	156.65%	≥120%	≥100%	
净资本/净资产	11	87.74%	83.08%	≥24%	≥20%	
净资本/负债	12	45.22%	44.71%	≥9.6%	≥8%	
净资产/负债	13	51.53%	53.82%	≥12%	≥10%	
自营权益类证券及证券衍生品/净资本	14	25.08%	30.76%	≤80%	≤100%	
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	15	175.72%	176.72%	≤400%	≤500%	
持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名	16			≤24%	≤30%	
其中：				\	\	
恒瑞医药	17	-	1.57%	\	\	
中国平安	18	0.44%	1.32%	\	\	
富国中证国企一带一路ETF	19	-	1.21%	\	\	
建设银行	20	-	0.89%	\	\	
长江电力	21	-	0.87%	\	\	
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名	22			≤4%	≤5%	
其中：				\	\	
华夏中证全指房地产ETF	23	-	3.42%	\	\	
富国中证国企一带一路ETF	24	-	2.42%	\	\	
鹏华中证银行	25	-	2.30%	\	\	
东兴蓝海财富	26	2.23%	1.39%	\	\	
酒鬼酒	27	-	0.70%	\	\	
持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例前五名	28			≤16%	≤20%	
其中：				\	\	
东兴金选兴盛53号集合资产管理计划	29	16%	20.00%	\	\	
东兴添多利集合资产管理计划	30	17.62%	19.41%	\	\	
2017年高密市城市建设投资集团有限公司养老产业专项债券	31	16.00%	16.00%	\	\	
河南中原金控有限公司非公开发行2019年公司债券(第一期)	32	-	16.00%	\	\	
绍兴市上虞区水务集团有限公司2019年度第二期短期融资券	33	-	16.00%	\	\	
融资(含融券)的金额/净资本	34	88.32%	101.49%	≤320%	≤400%	

证券公司风险控制指标计算表 - 续

编制单位：东兴证券股份有限公司

2019年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
对单一客户融资(含融券)业务规模与净资本的比例前五名	35			≤4%	≤5%	
其中：				\	\	
虞云新	36	4.14%	4.22%	\	\	
夏曙东	37	2.64%	2.24%	\	\	
杨云春	38	2.25%	2.11%	\	\	
石河子骏扬	39	2.37%	1.81%	\	\	
冯宇霞	40	1.30%	1.72%	\	\	
接受单只担保股票市值与该股票总市值比例前五名	41			≤16%	≤20%	
其中：				\	\	
济民制药	42	-	5.20%	\	\	
青岛中程	43	-	5.02%	\	\	
应流股份	44	5.56%	4.94%	\	\	
中潜股份	45	0.03%	4.38%	\	\	
卫宁健康	46	3.02%	4.01%	\	\	

一、 公司基本情况

东兴证券股份有限公司(以下简称“本公司”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东兴证券股份有限公司开业的批复》(证监机构字[2008]665号)批准于2008年5月28日成立,注册地为北京,注册资本为人民币15.04亿元,2011年10月27日,中国证监会出具证监许可[2011]1727号《关于核准东兴证券股份有限公司变更注册资本的批复》,核准本公司注册资本由人民币15.04亿元增加至人民币20.04亿元。

2015年2月,经中国证监会证监许可[2015]191号文批准,本公司向社会公众首次公开发行500,000,000股人民币普通股(A股),并于2015年2月26日在上海证券交易所挂牌上市。本公司首次公开发行前总股本为2,004,000,000股,发行上市后总股本为2,504,000,000股。股票发行价格为人民币9.18元/股,募集资金人民币4,590,000,00元。

2016年10月,经中国证监会证监许可[2016]1352号文批准,本公司非公开发行253,960,657股人民币普通股(A股),并于2016年10月17日在上海证券交易所上市交易。本公司非公开发行前总股本为2,504,000,000股,发行后总股本为2,757,960,657股。非公开发行股票价格为人民币18.81元/股,募集资金人民币4,776,999,958.17元。

本公司的主要经营业务范围包括:证券经纪,证券投资咨询,与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问,证券承销与保荐,证券自营,证券资产管理,融资融券,证券投资基金销售,代销金融产品,公开募集证券投资基金管理,保险兼业代理业务等。

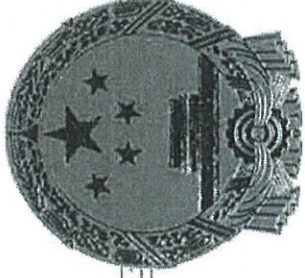
本公司的母公司为中国东方资产管理股份有限公司。

二、 监管报表的编制基础

本监管报表系本公司为向证券监管机构呈交之目的而编制。

本风险控制指标监管报表是按照中国证券监督管理委员会《关于修改〈证券公司风险控制指标管理办法〉的决定》(证监会第125号令)、《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告[2016]10号)、《关于证券公司风险控制指标监管报表填报有关事项的通知》(机构部函[2016]2489号)等相关规定等规定编制。

* * * 监管报表结束 * * *

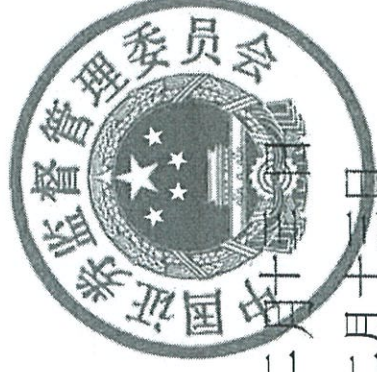


证书序号: 000400

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

经财政部、中国证券监督管理委员会审查, 批准
德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人: 曾顺福



证书号: 36

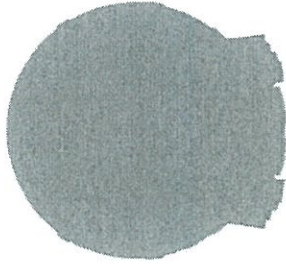
发证时间: 2020年12月12日

证书有效期至: 2020年12月12日

证书序号: 0004094

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止或执业许可注销的，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



会计师事务所 执业证书

名称: 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

首席合伙人: 曾顺福

主任会计师:

经营场所: 上海市延安东路 222 号 30 楼

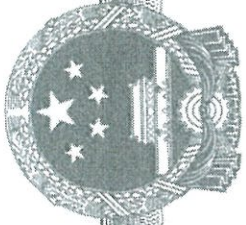
组织形式: 特殊的普通合伙企业

执业证书编号: 31000012

批准执业文号: 财会函(2012)40号

批准执业日期: 二〇一二年九月十四日





营业执照

(副本)

扫描二维码登录
“国家企业信用信息公示系统”
了解更多登记、备案信息。



统一社会信用代码

913100005587870XB

证照编号: 00000002201907230045

名称 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

类型 外商投资特殊普通合伙企业

执行事务合伙人 曾顺福

经营范围 审查企业会计报表,出具审计报告,验证企业资本,出具验资报告;办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务,出具有关报告;基本建设年度财务决算审计;代理记账;会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训;法律、法规规定的其他业务。
【依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动】

成立日期 2012年10月19日

合伙期限 2012年10月19日至 不约定期限

主要经营场所 上海市黄浦区延安东路222号30楼



登记机关

2019年07月23日

市场主体应当于每年1月1日至6月30日通过
国家企业信用信息公示系统报送公示年度报告。

国家企业信用信息公示系统网址: <http://www.gsxt.gov.cn>

国家市场监督管理总局监制

183



姓 名 李燕
 Full name
 性 别 女
 Sex
 出生日期 1977-3-31
 Date of birth
 工作单位 新道中会计师事务所有限公司北京分所
 Working unit
 身份证号码 652322197703310523
 Identity card No.

证书编号: 31000007031P
No. of Certificate

批准注册协会: 北京注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

发证日期: 2007年 11月 28日
Date of Issuance

年度检验
Annual Renewal

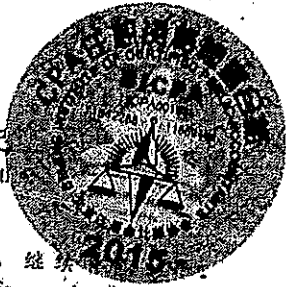
本证书经检验合格
This certificate is valid after
this renewal.



北京注册会计师协会
2007年度年检合格印章

2008年 3月 20日
Date of Renewal

年度检验登记
Annual Renewal Registrati



格，继续
id for another year after



9 年 3 月 20 日

6

年度检验登记
Annual Renewal Registrati



本证书经检验合格，
This certificate is valid for another
this renewal.



2010 年 3 月 16 日

7

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after
this renewal.



年 月 日

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after
this renewal.



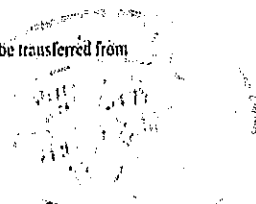
姓名：李燕

证书编号：310000070319

年 月 日

注册会计师工作单位变更事项登记
Registration of the Change of Working Unit by a CPA

同意调出
Agree the holder to be transferred from

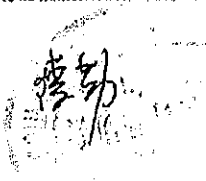


事务所
CPAs

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

2012年 3月 2日
ly im 日

同意调入
Agree the holder to be transferred to



事务所
CPAs

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

2012年 3月 2日
ly im 日

注册会计师工作单位变更事项登记
Registration of the Change of Working Unit by a CPA

同意调出
Agree the holder to be transferred from

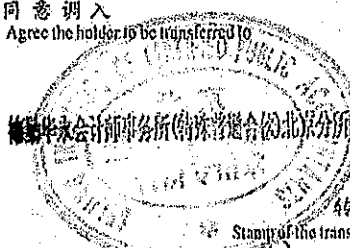


事务所
CPAs

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

2013年 2月 4日
ly im 日

同意调入
Agree the holder to be transferred to



事务所
CPAs

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

2013年 2月 4日
ly im 日



姓名	邱丽
Full name	邱丽
性别	女
Sex	女
出生日期	1983-10-14
Date of birth	1983-10-14
工作单位	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所
Working unit	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所
身份证号码	120106198310145529
Identity card No.	120106198310145529

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after
this renewal.



证书编号:
No. of Certificate 310000125666

批准注册协会:
Authorized Institute of CPA 北京注册会计师协会

发证日期:
Date of Issuance 2017 年 10 月 18 日

姓名: 邱丽
证书编号: 310000125666

年 月 日
/y /m /d