

兴业证券股份有限公司

风险控制指标监管报表
及专项审计报告
2018年12月31日

兴业证券股份有限公司
风险控制指标监管报表及专项审计报告
2018年12月31日

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

专项审计报告

德师报(审)字(19)第 S00129 号
(第 1 页, 共 3 页)

兴业证券股份有限公司董事会:

一、审计意见

我们审计了兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”)的风险控制指标监管报表,包括 2018 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一所述编制基础编制。

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,我们独立于兴业证券,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一对编制基础的说明。兴业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

兴业证券管理层负责按照风险控制指标监管报表附注一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。

治理层负责监督兴业证券的风险控制指标监管报表报告过程。

专项审计报告(续)

德师报(审)字(19)第 S00129 号
(第 2 页, 共 3 页)

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。

(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、结构和内容(包括披露), 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一所述编制基础编制。

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)。

专项审计报告(续)

德师报(审)字(19)第 S00129 号
(第 3 页, 共 3 页)

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:

曾浩



中国注册会计师:

朱玮琦



2019 年 4 月 1 日

净资本计算表

兴业证券股份有限公司

2018年12月31日

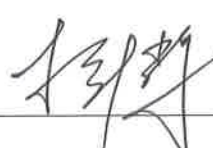
单位：人民币元

项目	行次	2017年12月31日	2018年12月31日	扣减比例	应计算的金额	
					2017年12月31日	2018年12月31日
净资产	1	30,894,342,117.45	30,512,976,718.03		30,894,342,117.45	30,512,976,718.03
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	7,268,940,893.78	8,431,705,183.98		6,824,134,522.63	7,994,676,253.14
存出保证金	4	485,709,278.11	474,266,298.65		40,902,906.96	37,237,367.81
其中：履约保证金	5	342,995,859.60	351,519,778.07	10%	34,299,585.96	35,151,977.81
期货保证金	6	6,603,321.00	2,085,390.00	100%	6,603,321.00	2,085,390.00
其他存出保证金	7	136,110,097.51	120,661,130.58		-	-
长期股权投资	8	5,236,114,054.26	5,919,192,398.87	100%	5,236,114,054.26	5,919,192,398.87
投资性房地产、固定资产	9	730,978,176.27	733,562,915.64	100%	730,978,176.27	733,562,915.64
其他(注1)	10	816,139,385.14	1,304,683,570.82	100%	816,139,385.14	1,304,683,570.82
减：或有负债的风险调整合计	11	1,058,944,254.80	1,056,933,563.57		1,058,944,254.80	1,056,933,563.57
对外担保金额及担保承诺(注2)	12	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	100%	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
其他或有负债	13	58,944,254.80	56,933,563.57	100%	58,944,254.80	56,933,563.57
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				23,011,263,340.02	21,461,366,901.32
加：附属净资本	21	37,723,698,018.66	27,264,255,211.19		11,505,000,000.00	9,100,000,000.00
借入的次级债(含永续次级债)(注3)	22	37,723,698,018.66	27,264,255,211.19		11,505,000,000.00	9,100,000,000.00
中国证监会认定或核准的其他调整项目	23	-	-		-	-
净资本	24				34,516,263,340.02	30,561,366,901.32

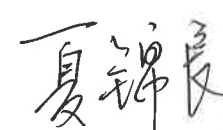

附：其他需要特别说明的事项：

- 其他资本扣除项包括商誉、递延所得税资产、无形资产、应收融资融券客户款、待转承销费用、抵债资产、长期待摊费用等其他资产。持有的金融资产不扣减净资本。
- 本年余额为向兴证证券资产管理有限公司提供的净资本担保人民币10亿元。
- 根据《证券公司次级债管理规定》(证监会公告[2012]51号)，证券公司借入或发行长期次级债。到期期限在3、2、1年以上的，原则上分别按100%、70%、50%的比例计入净资本，且长期次级债计入净资本的数额不得超过净资本(不含长期次级债累计计入净资本的数额)的50%。兴业证券本次发行次级债按期限计算余额超过了净资本(不含长期次级债累计计入净资本的数额)的50%，故选择将部分长期次级债计入净资本，计入比例未超过净资本(不含长期次级债累计计入净资本的数额)的50%。

第4页至第11页监管报表由下列负责人签署：




 法定代表人

 主管会计工作负责人




 首席风险官

风险资本准备计算表

兴业证券股份有限公司

2018年12月31日

单位：人民币元

项目	行次	2017年12月31日	2018年12月31日	计算标准	风险资本准备	
					2017年12月31日	2018年12月31日
1.市场风险资本准备	1	52,865,405,015.82	58,296,383,943.34		9,603,217,003.66	8,906,372,186.16
其中：(1)权益类证券及其衍生品规模	2	7,582,239,013.18	6,000,465,828.56		2,103,039,396.66	1,634,018,377.99
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	3	1,378,275,154.89	1,569,557,853.52	15%	206,741,273.23	235,433,678.03
上市股票(注1)	4	5,971,336,696.32	4,110,233,873.13	30%	1,791,401,008.90	1,233,070,161.94
流通受限的股票	5	199,699,334.18	216,381,131.69	50%	99,849,667.09	108,190,565.85
其他股票	6	2,506,663.80	66,992,393.08	80%	2,005,331.04	53,593,914.46
权益类基金	7	30,421,163.99	37,300,577.14	10%	3,042,116.40	3,730,057.71
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	-	-	20%	-	-
买入期权	10	-	-	100%	-	-
其他	11	-	-		-	-
(2)非权益类证券及其衍生品规模	12	44,760,120,833.45	52,275,200,357.28		7,492,920,610.12	7,271,485,920.29
国债、中央银行票据、国开债	13	521,290,029.50	1,046,115,230.00	0%	-	-
政策性金融债、政府支持机构债券	14	2,032,543,340.00	1,351,297,750.00	2%	40,650,866.80	27,025,955.00
地方政府债	15	1,701,608,200.00	1,040,578,220.00	5%	85,080,410.00	52,028,911.00
信用评级AAA级的信用债券	16	11,908,027,675.08	24,361,793,863.62	10%	1,190,802,767.51	2,436,179,386.36
信用评级AAA级以下，AA级(含)以上的信用债券	17	14,695,596,071.97	11,690,585,101.04	15%	2,204,339,410.80	1,753,587,765.16
信用评级AA级以下，BBB级(含)以上的信用债券	18	123,055,390.00	1,357,032.90	50%	61,527,695.00	678,516.45
信用评级BBB级以下的信用债券(注2)	19	394,586,820.00	187,842,945.00	80%	315,669,456.00	150,274,356.00
非权益类基金	20	6,798,561,699.39	5,713,687,256.46	10%	348,338,613.14	312,825,022.83
其中：货币基金	21	6,630,351,135.88	5,170,874,056.25	5%	331,517,556.79	258,543,702.81
国债期货、债券远期及利率互换	22	120,229,375.00	60,000,000.00	20%	24,045,875.00	12,000,000.00
集合及信托等产品	23	39,382,401.55	2,533,865,905.76		9,845,600.39	382,847,481.24
其中：未约定先行承担亏损(注3)	24	39,382,401.55	2,533,865,905.76	25%	9,845,600.39	382,847,481.24
约定先行承担亏损	25	-	-	50%	-	-
定向产品	26	6,425,239,830.96	4,288,077,052.50	50%	3,212,619,915.48	2,144,038,526.25
大宗商品现货(含黄金)	27	-	-	8%	-	-
大宗商品衍生品	28	-	-	20%	-	-
其他	29	-	-		-	-
(3)已对冲风险的权益类证券及其衍生品	30	50,663,629.69	16,517,757.50		2,533,181.48	825,887.88
权益类证券	31	47,563,629.69	14,432,367.50	5%	2,378,181.48	721,618.38
权益类衍生品	32	3,100,000.00	2,085,390.00	5%	155,000.00	104,269.50
(4)已对冲风险的非权益类证券及其衍生品	33	472,381,539.50	4,200,000.00		4,723,815.40	42,000.00
非权益类证券	34	449,992,327.00	-	1%	4,499,923.27	-
非权益类衍生品	35	22,389,212.50	4,200,000.00	1%	223,892.13	42,000.00
2.信用风险资本准备	36	47,896,266,039.74	34,983,932,087.32		7,853,749,226.60	5,586,247,239.52
融资类业务	37	45,270,227,637.11	32,801,609,544.71		7,623,198,838.33	5,354,342,878.52
其中：场内融资业务	38	45,270,227,637.11	32,801,609,544.71	10%	7,623,198,838.33	5,354,342,878.52
其中：股票质押回购	39	30,961,760,746.19	20,741,819,240.49	20%	6,192,352,149.24	4,148,363,848.10
场外融资业务	40	-	-	30%	-	-
应收账款	41	522,107,954.95	1,307,842,542.61		209,511,083.79	223,159,561.00
其中：账龄1年以内(含1年)	42	347,329,856.84	1,205,203,312.90	10%	34,732,985.68	120,520,331.29
账龄1年以上、应收股东及其关联公司款项	43	174,778,098.11	102,639,229.71	100%	174,778,098.11	102,639,229.71
其他(注4)	44	2,103,930,447.68	874,480,000.00	1%	21,039,304.48	8,744,800.00
3.操作风险资本准备	45	7,068,422,836.66	8,159,012,236.76		1,107,681,696.91	1,300,568,166.44
证券经纪业务净收入	46	2,195,531,818.79	2,168,981,776.63	12%	263,463,818.25	260,277,813.20
证券投资咨询业务净收入	47	30,171,611.03	27,850,205.58	12%	3,620,593.32	3,342,024.67
证券承销与保荐业务、财务顾问业务净收入	48	1,011,113,422.47	1,208,137,241.49	15%	151,667,013.37	181,220,586.22
证券资产管理业务净收入	49	25,293,507.34	-	15%	3,794,026.10	-
证券自营业务净收入	50	1,863,198,159.92	2,378,961,554.83	18%	335,375,668.79	428,213,079.87
融资类业务及其他业务净收入	51	1,943,114,317.11	2,375,081,458.24	18%	349,760,577.08	427,514,662.48
4.特定风险资本准备	52	3,616,343,112.74	5,454,219,303.14		25,314,401.79	38,179,535.12
证券公司资产管理业务	53	3,616,343,112.74	5,454,219,303.14		25,314,401.79	38,179,535.12
其中：结构化集合资管计划	54	-	-	1%	-	-
投资非标资产的定向资管计划	55	-	-	0.9%	-	-
各类私募投资基金(含各类直投基金)	56	3,616,343,112.74	5,454,219,303.14	0.7%	25,314,401.79	38,179,535.12
其他定向资管计划	57	-	-	0.5%	-	-
参与股票质押回购的资产管理业务	58	-	-	1.5%	-	-
其中：集合资管计划	59	-	-	1.5%	-	-
定向资管计划	60	-	-	1.5%	-	-
专项资管计划	61	-	-	1.5%	-	-
分类调整前的各项风险资本准备合计	62				18,589,962,328.96	15,831,367,127.24
分类调整后的各项风险资本准备合计(注5)	63				16,730,966,096.06	12,665,093,701.79

续上表

附：其他需要特别说明的事项：

1. 本项内包含本公司对中国证券金融股份有限公司专户的投资，按规定参照股票，按期末余额的 30%的基准计算风险资本准备。
2. 此项下债券为债券及发行主体均未评级的非公开发行之可交换债券。
3. 根据《关于支持证券投资基金经营机构积极参与化解上市公司股票质押风险、支持民营企业发展的通知》(闽证监发[2018]265号)，证券公司参与认购专项用于化解上市公司股票质押风险、支持民营企业发展的各类资产管理计划的，减半计算市场风险资本准备。
4. 根据《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)，本项余额为债券逆回购交易(融出资金)，按 1%扣除。
5. 根据中国证监会 2018 年 7 月 27 日发布的《中国证监会公布 2018 年证券公司分类结果》，本公司 2018 年度的分类结果为 A 类 A 级，监管报表 2018 年 12 月 31 日的数据采用 A 类的标准计算，调整系数为 0.8(2017 年 12 月 31 日的数据采用 B 类的标准计算，调整系数为 0.9)。

表内外资产总额计算表

兴业证券股份有限公司

2018年12月31日

单位：人民币元

项目		行次	期末金额	转换系数	折算后金额
表内资产	表内资产总额	1	122,258,368,119.62	100%	122,258,368,119.62
	减：表内资产扣除项	2	13,636,993,806.23		13,636,993,806.23
	1. 客户资金	3	13,636,993,806.23		13,636,993,806.23
	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	13,479,802,598.96	100%	13,479,802,598.96
	其他(注1)	5	157,191,207.27		157,191,207.27
	表内资产余额	6	108,621,374,313.39		108,621,374,313.39
表外项目	1. 证券衍生产品	7	66,285,390.00		66,285,390.00
	国债期货、债券远期及利率互换	8	64,200,000.00	100%	64,200,000.00
	股指期货、权益互换及卖出股票期权	9	2,085,390.00	100%	2,085,390.00
	大宗商品衍生品	10	-	100%	-
	卖出场外期权	11	-	100%	-
	其他	12	-		-
	2. 资产管理业务	13	5,454,219,303.14	0.2%	10,908,438.61
	3. 其他表外项目	14	6,127,458,763.57		1,310,986,083.57
	转融通融入证券	15	10,525,200.00	10%	1,052,520.00
	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	5,060,000,000.00	5%	253,000,000.00
	对外担保金额及担保承诺	19	1,000,000,000.00	100%	1,000,000,000.00
	其他或有事项	20	56,933,563.57	100%	56,933,563.57
	表外项目余额	21	11,647,963,456.71		1,388,179,912.18
表内外资产总额	22			110,009,554,225.57	

附：其他需要特别说明的事项：

1、 根据《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)，本项余额为属于客户资金的股票期权客户保证金，按100%扣除。

流动性覆盖率计算表

兴业证券股份有限公司

2018年12月31日

单位：人民币元

项目	序号	期末金额	折算率	折算后金额
优质流动性资产	1	24,428,040,595.89		20,448,372,091.60
其中：货币资金	2	3,581,235,948.34	100%	3,581,235,948.34
结算备付金	3	494,253,010.41	100%	494,253,010.41
国债、中央银行票据、国开债	4	1,046,115,230.00	100%	1,046,115,230.00
或：已冻结或质押部分	5	107,193,350.00	100%	107,193,350.00
政策性金融债、政府支持机构债券	6	1,351,297,750.00	98%	1,324,271,795.00
减：已冻结或质押部分	7	978,040,840.00	98%	958,480,023.20
地方政府债	8	1,040,578,220.00	95%	988,549,309.00
减：已冻结或质押部分	9	736,750,000.00	95%	699,912,500.00
信用评级 AAA 级的信用债券	10	21,885,096,688.44	96%	21,009,692,820.90
减：已冻结或质押部分	11	17,973,289,510.00	96%	17,254,357,929.60
信用评级 AAA 级以下，AA 级(含)以上的信用债券	12	11,585,805,101.04	90%	10,427,224,590.94
减：已冻结或质押部分	13	3,465,549,121.00	90%	3,118,994,208.90
货币基金	14	5,170,874,056.25	60%	3,102,524,433.75
上海 180 指数、深圳 100 指数、沪深 300 指数 ETF 及成分股	15	1,533,607,412.41	40%	613,442,964.96
减：已冻结或质押部分	16	-	40%	-
未来 30 日现金流出	17	65,580,009,766.94		4,482,583,362.93
1.30 日内到期的负债现金流出	18	23,709,875,615.44		2,132,989,936.62
短期借款	19	-	100%	-
拆入资金	20	-	100%	-
卖出回购(按质押物分类)	21	22,487,931,035.89		911,045,357.07
其中：国债、中央银行票据、国开债	22	1,797,666,082.19	0%	-
政策性金融债、政府支持机构债券	23	956,005,053.70	2%	19,120,101.07
地方政府债	24	3,247,960,000.00	5%	162,398,000.00
信用评级 AAA 级的信用债券	25	15,318,378,900.00	4%	612,735,156.00
信用评级 AAA 级以下，AA 级(含)以上的信用债券	26	1,167,921,000.00	10%	116,792,100.00
债券基金	27	-	10%	-
其他	28	-	100%	-
应付职工薪酬、税费、利息和股利	29	508,070,057.02	100%	508,070,057.02
交易性金融负债、衍生金融负债	30	296,149.53	100%	296,149.53
30 日内须偿还的次级债务和其他债务	31	713,578,373.00	100%	713,578,373.00
2.或有负债	32	1,056,933,563.57		31,708,006.91
对外担保金额及担保承诺	33	1,000,000,000.00	3%	30,000,000.00
其他或有事项	34	56,933,563.57	3%	1,708,006.91
3.自营业务及长期投资资金流出	35	2,153,902,600.00		4,920,520.00
利率互换	36	2,140,000,000.00	0.1%	2,140,000.00
国债期货及债券远期	37	-	4%	-
股指期货	38	13,902,600.00	20%	2,780,520.00
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	5,060,000,000.00		253,000,000.00
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	5,060,000,000.00	5%	253,000,000.00
5.融资类业务资金流出	45	33,199,297,987.93	5%	1,659,964,899.40
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	400,000,000.00		400,000,000.00
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	3,436,357,785.16		2,372,917,801.34
1.30 日内到期的短期资金流入	51	1,060,956,446.39		880,270,223.20
银行承兑汇票	52	-	100%	-
拆出资金	53	-	50%	-
买入返售金融资产	54	874,480,000.00	90%	787,032,000.00
应收股利、应收利息	55	186,476,446.39	50%	93,238,223.20
2. 自营业务资金流入	56	19,787,635.00		14,840,726.25
30 日内到期的信用评级 AA 级以下(不含)的信用债券	57	19,787,635.00	75%	14,840,726.25
3.未使用的不可撤销金融机构授信额度	58	1,200,000,000.00	75%	900,000,000.00
4.其他资金流入	59	1,155,613,703.77		577,806,851.89
集中清算交易在途结算资金	60	1,155,613,703.77	50%	577,806,851.89
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	62,143,651,981.78		2,109,665,561.59
流动性覆盖率(LCR)	63			969.27%

附：其他需要特别说明的事项：无

净稳定资金率计算表

兴业证券股份有限公司

2018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	122,258,368,119.62		58,409,745,038.36
其中：1.净资产	2	30,512,976,718.03	100%	30,512,976,718.03
2.剩余存续期大于等于1年的借款和负债	3	27,896,768,320.33		27,896,768,320.33
次级债券	4	14,973,304,835.23	100%	14,973,304,835.23
长期借款	5	-	100%	-
应付债券	6	12,923,463,485.10	100%	12,923,463,485.10
其他	7	-	100%	-
3.所有其他负债和权益	8	63,848,623,081.26	0%	-
所需稳定资金	9	116,892,210,476.96		41,500,011,892.94
其中：1.高流动性资产	10	11,750,723,017.42		-
货币资金	11	3,581,235,948.34	0%	-
结算备付金	12	1,649,866,714.18	0%	-
拆出资金(不足1年)	13	-	0%	-
存出保证金	14	474,266,298.65	0%	-
买入返售金融资产	15	874,480,000.00	0%	-
货币基金	16	5,170,874,056.25	0%	-
2.剩余存续期不足1年的证券	17	2,459,553,815.53		15,979,360.56
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	394,271,100.00	0%	-
信用评级AAA级的信用债券	21	850,440,240.00	0%	-
信用评级AAA级以下，AA级(含)以上的信用债券	22	1,119,069,080.53	1%	11,190,690.81
信用评级AA级以下，BBB级(含)以上的信用债券	23	-	3%	-
信用评级BBB级以下的信用债券	24	95,773,395.00	5%	4,788,669.75
3.剩余存续期大于等于1年证券	25	37,059,758,564.20		4,640,954,507.04
国债、中央银行票据、国开债	26	1,046,115,230.00	5%	52,305,761.50
政策性金融债、政府支持机构债券	27	1,351,297,750.00	5%	67,564,887.50
地方政府债	28	646,307,120.00	5%	32,315,356.00
信用评级AAA级的信用债券	29	23,420,600,558.00	10%	2,342,060,055.80
信用评级AAA级以下，AA级(含)以上的信用债券	30	10,503,368,356.20	20%	2,100,673,671.24
信用评级AA级以下，BBB级(含)以上的信用债券	31	-	30%	-
信用评级BBB级以下的信用债券	32	92,069,550.00	50%	46,034,775.00
4.股票	33	5,905,310,178.42		2,785,313,528.41
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	34	1,545,141,615.91	30%	463,542,484.77
一般上市股票	35	4,076,795,037.74	50%	2,038,397,518.87
流通受限的股票及其他股票	36	283,373,524.77	100%	283,373,524.77
5.可转换债券	37	145,257,762.83	30%	43,577,328.85
6.衍生金融资产	38	296,149.53	0%	-
7.证券投资基金	39	594,546,144.85		64,627,908.95
非权益类基金	40	542,813,200.21	10%	54,281,320.02
权益类基金	41	51,732,944.64	20%	10,346,588.93
其中：分级基金中非优先级基金	42	-	50%	-
8.其他现金管理类产品	43	-	20%	-
9.融出资金	44	12,425,341,687.44		5,762,670,843.72
自有资金融出资金	45	11,425,341,687.44	50%	5,712,670,843.72
转融通融出资金	46	1,000,000,000.00	5%	50,000,000.00
10.约定购回融出资金	47	32,137,060.00	50%	16,068,530.00
11.股票质押式回购融出资金	48	20,741,819,240.49		11,707,050,994.25
到期日在1年以内(含)的融出资金	49	15,397,253,744.49	50%	7,698,626,872.25
到期日在1年以上(不含)的融出资金	50	5,344,565,496.00	75%	4,008,424,122.00
12.1年以内的应收款项、应收股利、应收利息	51	2,722,153,583.41	50%	1,361,076,791.71
13.其他所有资产	52	14,784,477,109.27	100%	14,784,477,109.27
14.表外项目	53	8,270,836,163.57		318,214,990.18
14.1 证券衍生品	54	2,153,902,600.00		12,368,312.00
利率互换	55	2,140,000,000.00	0.5%	10,700,000.00
国债期货及债券远期	56	-	3%	-
股指期货	57	13,902,600.00	12%	1,668,312.00
14.2 其他表外项目	58	6,116,933,563.57		305,846,678.18
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	5,060,000,000.00	5%	253,000,000.00
对外担保金额及担保承诺	62	1,000,000,000.00	5%	50,000,000.00
其他或有事项	63	56,933,563.57	5%	2,846,678.18
净稳定资金率(NSFR)	64			140.75%

附：其他需要特别说明的事项：无。

风险控制指标计算表

兴业证券股份有限公司

2018年12月31日

单位：人民币元

项 目	行次	2017年12月31日	2018年12月31日	预警标准	监管标准	备注
核心净资本	1	23,011,263,340.02	21,461,366,901.32			
附属净资本	2	11,505,000,000.00	9,100,000,000.00			
净资本	3	34,516,263,340.02	30,561,366,901.32			
净资产	4	30,894,342,117.45	30,512,976,718.03			
各项风险资本准备之和	5	16,730,966,096.06	12,665,093,701.79			
表内外资产总额	6	113,890,629,256.96	110,009,554,225.57			
风险覆盖率	7	206.30%	241.30%	≥120%	≥100%	
资本杠杆率	8	21.13%	20.47%	≥9.6%	≥8%	
流动性覆盖率	9	780.17%	969.27%	≥120%	≥100%	
净稳定资金率	10	140.19%	140.75%	≥120%	≥100%	
净资本/净资产	11	111.72%	100.16%	≥24%	≥20%	
净资本/负债	12	42.32%	39.13%	≥9.6%	≥8%	
净资产/负债	13	37.88%	39.06%	≥12%	≥10%	
自营权益类证券及其衍生品/净资本	14	22.11%	19.69%	≤80%	≤100%	
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	15	131.05%	171.06%	≤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：	17					
正泰电器	18	0.16%	1.93%			
中国太平(港股通)	19	0.85%	1.31%			
华域汽车	20	0.04%	1.29%			
白云山(港股通)	21	0.08%	0.75%			
鲁阳节能	22	0.19%	0.61%			
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名(注1)	23			≤4%	≤5%	
其中：	24					
洁利来(做市)	25	4.73%	4.90%			
雷钰股份(做市)	26	4.68%	4.68%			
中通电气(做市)	27	4.47%	4.47%			
固特超声(做市)	28	4.35%	4.35%			
天狐创意(做市)	29	4.19%	4.27%			
持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例前五名(注2)	30			≤16%	≤20%	
16 沿江 02	31	20.00%	20.00%			
15 浙交 02	32	20.00%	20.00%			
18 福新 Y2	33	0.00%	15.00%			
18 联投 Y3	34	0.00%	15.00%			
17 章控 E1 等 (注3)	35	15.00%	15.00%			
融资(含融券)的金额/净资本	36	131.16%	107.33%	≤320%	≤400%	
对单一客户融资(含融券)业务规模与净资本的比例前五名	37			≤4%	≤5%	
其中：	38					
中南城市建设投资有限公司	39	2.32%	2.62%			
张铭豪	40	1.83%	2.06%			
浙江华通控股集团有限公司	41	1.74%	1.96%			
华勇	42	2.25%	1.95%			
洪杰	43	1.20%	1.52%			
接受单一担保股票市值与该股票总市值比例前五名	44			≤16%	≤20%	
其中：	45					
富邦股份	46	0.04%	11.25%			
冲农基因	47	0.07%	10.52%			
昂立教育	48	0.00%	6.59%			
开能健康	49	0.00%	5.71%			
国农科技	50	0.06%	4.74%			

附：其他需要特别说明的事项：

- 1、 根据《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)，本公司2018年12月31日持有的新三板股票东邦御厨、皇品文化、鑫平线和希奥信息的市值占总市值比例超过5%，系因本公司担任其做市商，予以豁免填列。
- 2、 本公司2018年12月31日持有的证券行业支持民企发展系列之兴业证券1号FOF集合资产管理计划的规模与其总规模比例超过20%，根据《关于支持证券基金经营机构积极参与化解上市公司股票质押风险、支持民营企业发展的通知》(闽证监发[2018]265号)，不认定为违反监管标准，予以豁免填列。
- 3、 除上表所列项目外，本公司2018年12月31日持有的18深航06、14江宁经开债、16嘉兴经技MTN001、17首钢E2、16淮开02、17云投EB、18竟01EB、16仪水务、16龙岩铁建债及16荆门管廊项目债的规模与其总规模比例均为15%。

一、 编制基础

本风险控制指标监管报表及其附注(以下简称“风险控制指标监管报表”)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)等的规定编制。

*** 风险控制指标监管报表结束 ***