

方正证券股份有限公司

关于 2020 年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 2020 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	本报告期末 (2020 年 12 月 31 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
净资本	20,958,329,450.55	20,903,236,065.74
净资产	39,381,435,005.68	38,501,756,893.55
风险覆盖率 (%)	337.16	259.00
资本杠杆率 (%)	27.30	23.49
流动性覆盖率 (%)	154.60	232.05
净稳定资金率 (%)	142.08	139.58
净资本/净资产 (%)	53.22	54.29
净资本/负债 (%)	54.91	42.83
净资产/负债 (%)	103.17	78.88
自营权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	32.96	32.41
自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	104.03	175.42
各项风险资本准备之和	6,216,214,828.00	8,070,708,318.68

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预警标准。

报告期内，当公司出现风险控制指标达到中国证监会规定的预警标准或者不符合规定标准的情况时，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。

三、资本补足情况

2020 年公司通过净利润留存等补充净资本，2020 年 12 月末公司净资本为 209.58 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

2021年4月29日