

方正证券股份有限公司

关于 2022 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 2022 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 (2022 年 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
净资本	24,699,486,530.36	24,643,923,206.95
净资产	42,660,560,279.65	41,381,523,115.33
风险覆盖率 (%)	288.31	306.96
资本杠杆率 (%)	18.94	20.05
流动性覆盖率 (%)	139.43	151.07
净稳定资金率 (%)	139.10	135.08
净资本/净资产 (%)	57.90	59.55
净资本/负债 (%)	29.85	31.20
净资产/负债 (%)	51.55	52.39
自营权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	37.92	20.54
自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	268.21	244.45
融资 (含融券) 的金额/净资本 (%)	113.42	113.18

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。

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

2022 年公司通过净利润留存等补充净资本，2022 年 12 月末公司净资本为 246.99 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
2023 年 2 月 28 日