

方正证券股份有限公司

2023 年度风险控制指标相关情况报告

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 2023 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 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
净资本	28,060,406,116.85	24,699,486,530.36
净资产	44,247,908,523.42	42,660,560,279.65
风险覆盖率 (%)	248.53	288.31
资本杠杆率 (%)	14.94	18.94
流动性覆盖率 (%)	222.99	139.43
净稳定资金率 (%)	162.26	139.10
净资本/净资产 (%)	63.42	57.90
净资本/负债 (%)	22.89	29.85
净资产/负债 (%)	36.09	51.55
自营权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	35.53	37.92
自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	341.50	268.21
融资 (含融券) 的金额/净资本 (%)	117.38	113.42

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规定标准。

三、资本补足情况

2023 年公司通过发行次级债、净利润留存等补充净资本，2023 年 12 月末公司净资本为 280.60 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
2024 年 3 月 20 日