

立信会
(特殊
文件

立信会
(特殊
文件

安信证券股份有限公司

净资本专项审计报告

信会师报字[2016]第 710488 号

安信证券股份有限公司

净资本专项审计报告

2015 年 12 月 31 日

	目 录	页 次
一、	审计报告	1-2
二、	净资本计算表	1-2
	风险控制指标监管报表	3-4
	风险资本准备计算表	5-6
	净资本监管报表说明	1-3



审 计 报 告

信会师报字[2016]第 710488 号

安信证券股份有限公司全体股东：

我们审计了安信证券股份有限公司（以下简称“安信证券”）编制的2015年12月31日净资产计算表、风险控制指标监管报表、风险资本准备计算表及其说明（以下统称“净资产监管报表”）。

一、管理层对净资产监管报表的责任

管理层负责按照中国证券监督管理委员会《证券公司风险控制指标管理办法》、《关于调整证券公司净资产计算标准的规定》和《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》等规定，以及《证券公司风控指标监管报表编报指引第 6 号》、《证券公司风控指标监管报表编报指引第 7 号》的要求编制和公允列报净资产监管报表，并负责设计、实施和维护必要的内部控制，以使净资产监管报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对净资产监管报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对净资产计算表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关净资产监管报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的净资产监管报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与净资产监管报表编制相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价净资产监管报表的总体列报。

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、审计意见

我们认为，安信证券 2015 年 12 月 31 日净资产监管报表已经按照中国证券监督管理委员会《证券公司风险控制指标管理办法》、《关于调整证券公司净资产计算标准的规定》和《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》等规定，以及《证券公司风控指标监管报表编报指引第 6 号》、《证券公司风控指标监管报表编报指引第 7 号》的要求编制。

四、其他说明

本专项审计报告仅供安信证券向中国证券监督管理委员会报送工作之用，不得用作任何其他目的，不应被视为是对安信证券日后资本保全、偿债能力和持续经营能力等的保证。若安信证券或任何第三方因使用本审计报告不当所造成的后果，与执行本业务的注册会计师及会计师事务所无关。

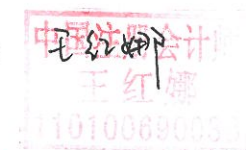
立信会计师事务所(特殊普通合伙)



中国注册会计师：



中国注册会计师：



二〇一六年三月二十八日

净资产计算表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：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	11,479,868,915.77	21,411,301,123.85		11,479,868,915.77	21,411,301,123.85
减：金融资产的风险调整合计	2	9,464,008,450.03	22,149,559,643.37		805,771,429.04	1,603,280,242.41
1. 股票 注1	3	1,024,858,982.64	2,465,100,685.60		137,541,706.87	195,847,969.92
其中：上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	4	370,701,875.76	1,018,636,182.79	5%	18,535,093.79	50,931,809.14
一般上市股票	5	118,490,290.93	1,445,900,655.81	10%	11,849,029.09	144,590,065.58
流通受限的股票	6	535,606,263.95		20%	107,121,252.79	
持有一种股票的市场价值与该股票市值的比例超过5%的	7			40%		
ST股票	8		122,130.00	50%		61,065.00
*ST股票	9	60,552.00	441,717.00	60%	36,331.20	265,030.20
已退市且在代办股份转让系统挂牌的股票	10			80%		
已退市且未在代办股份转让系统挂牌的股票	11			100%		
2. 货币市场基金	12		1,494,978,770.37			
3. 证券投资基金 注2	13	429,255,026.56	320,467,664.99	1%	4,292,550.27	3,204,676.65
4. 固定收益类证券 注3	14	4,870,229,726.05	9,955,627,704.64		311,930,641.32	323,150,749.46
其中：国债、中央银行票据	15		212,945,730.00			
金融债券、地方政府债	16		675,961,860.00	1%		6,759,618.60
信用评级AAA级的信用债券	17	776,684,426.00	4,151,054,294.12	2%	15,533,688.52	83,021,085.88
信用评级AAA级以下，BBB级（含）以上的信用债券	18	3,264,450,670.05	4,686,019,494.53	4%	130,578,026.80	187,440,779.78
信用评级BBB级以下的信用债券	19	829,094,630.00	229,646,326.00	20%	165,818,926.00	45,929,265.20
5. 可转换债券	20	842,610,922.11	652,000.00	5%	42,130,546.11	32,600.00
6. 信托产品投资 注4	21	41,731,159.73	10,000,000.00	80%	33,384,927.78	8,000,000.00
7. 集合理财计划投资	22	975,096,427.78	1,001,195,321.34		146,264,464.17	150,179,298.20
其中：投资其他证券公司集合理财计划	23			5%		
投资本公司集合理财计划（未约定先行承担亏损）	24			10%		
投资本公司集合理财计划（约定先行承担亏损）	25	975,096,427.78	1,001,195,321.34	15%	146,264,464.17	150,179,298.20
8. 委托其他证券公司、基金公司的定向、专户等理财投资 注5	26	1,134,748,258.48	6,156,774,279.54	10%	113,474,825.85	615,677,427.95
9. 其他金融产品投资 注6	27	145,477,946.68	744,763,216.89		16,751,766.67	307,187,520.23
减：衍生金融产品的风险调整合计	28	6,802,009.20	4,307,832.93		6,802,009.20	4,307,832.93
1. 权证投资	29			20%		
2. 利率互换公允价值变动收益形成的资产	30			100%		
3. 其他衍生金融资产 注7	31	6,802,009.20	4,307,832.93	100%	6,802,009.20	4,307,832.93
减：其他资产项目的风险调整合计	32	35,172,052,174.31	36,851,533,515.55		3,806,352,693.51	5,521,108,970.55
1. 拆出资金（合同期以内）	33					
2. 融出资金	34	26,764,434,174.08	27,559,878,119.99	2%	535,288,683.48	551,197,562.40
3. 融出证券 注8	35	207,234,509.42	1,274,827.91	5%	10,361,725.47	63,741.40
4. 约定购回融出资金 注9	36	13,498,263.11	35,317,873.56	5%	674,913.16	1,765,893.68
5. 股票质押融出资金 注9	37	3,338,938,711.78	1,738,900,275.55	10%	333,893,871.18	173,890,027.56
6. 买入返售金融资产（未逾期）	38	376,205,988.50	670,000,000.00	0%		
7. 应收利息	39	351,281,319.89	690,312,900.32	0%		
8. 存出保证金	40	813,509,439.16	535,341,659.73		154,147,766.52	197,331,057.60
其中：交易保证金	41	109,105,605.43	338,010,551.69	0%		
履约保证金	42	611,395,630.23	56.04	10%	61,139,563.02	5.60
期货保证金 注10	43	93,008,203.50	197,331,052.00	100%	93,008,203.50	197,331,052.00
其他存出保证金	44			100%		
9. 长期股权投资（不含对上市公司的股权投资）	45	1,592,384,173.88	3,158,159,806.80		1,592,384,173.88	3,158,159,806.80
其中：对控股证券业务子公司股权投资	46			100%		
对控股基金、期货等其他金融业务子公司股权投资 注	47	364,068,343.88	1,113,928,406.71	100%	364,068,343.88	1,113,928,406.71
对其他业务子公司股权投资 注11	48	300,000,000.00	800,000,000.00	100%	300,000,000.00	800,000,000.00
对境外子公司股权投资	49	828,315,830.00	828,315,830.00	100%	828,315,830.00	828,315,830.00
策略性股权投资 注12	50	100,000,000.00	415,915,570.09	100%	100,000,000.00	415,915,570.09
其他股权投资 注13	51			100%		

净资产计算表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：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
10. 投资性房地产	52	22,751,763.08	21,740,545.02	100%	22,751,763.08	21,740,545.02
11. 固定资产	53	231,097,634.81	282,342,981.77		231,097,634.81	282,342,981.77
其中：所有权属明确的房产	54	111,321,146.97	108,736,908.97	100%	111,321,146.97	108,736,908.97
其他固定资产	55	119,776,487.84	173,606,072.80	100%	119,776,487.84	173,606,072.80
12. 无形资产	56	646,323,465.04	634,160,376.35		643,646,727.23	632,696,526.42
其中：交易席位费	57	5,353,475.62	2,927,699.86	50%	2,676,737.81	1,463,849.93
其他无形资产	58	640,969,989.42	631,232,676.49	100%	640,969,989.42	631,232,676.49
13. 商誉	59	21,072,700.94	21,072,700.94	100%	21,072,700.94	21,072,700.94
14. 递延所得税资产	60		71,387,375.07	100%		71,387,375.07
15. 应收股利	61					
16. 应收融资融券客户款	62		423,858.50	100%		423,858.50
17. 应收款项	63	663,896,045.92	1,328,369,702.79		138,156,872.12	306,186,382.14
其中：账龄一年以内（含一年）	64	577,925,563.15	1,002,757,910.02	10%	57,792,556.31	100,275,791.00
账龄一年至二年（含二年）	65	11,212,333.92	239,402,403.27	50%	5,606,166.96	119,701,201.64
账龄二年以上	66	74,758,148.85	66,410,065.34	100%	74,758,148.85	66,410,065.34
应收股东及其关联公司款项	67		19,799,324.16	100%		19,799,324.16
18. 代理承销证券	68					
19. 代兑付债券	69					
20. 待转承销费用	70			100%		
21. 抵债资产	71			100%		
22. 长期待摊费用	72	53,286,170.47	38,681,601.37	100%	53,286,170.47	38,681,601.37
23. 其他 注14	73	69,589,691.17	64,168,909.88	100%	69,589,691.17	64,168,909.88
减：或有负债的风险调整合计	74					
1. 对外担保金额（公司为自身负债提供的反担保除外）	75			100%		
2. 对控股证券业务子公司提供的担保承诺	76			100%		
3. 其他或有负债 注15	77					
减：中国证监会认定的其他调整项目合计 注16	78	2,136,826.97	137,761,577.96		213,682.70	13,776,157.80
1. 所有权受限等无法变现的资产（如被冻结）	79			100%		
2. 其他项目	80	2,136,826.97	137,761,577.96	10%	213,682.70	13,776,157.80
加：中国证监会核准的其他调整项目 注16	81	6,496,674,260.29	22,499,088,376.74		3,248,337,130.15	7,134,413,960.08
1. 借入的次级债 注17	82	6,496,674,260.29	22,499,088,376.74		3,248,337,130.15	7,134,413,960.08
2. 母公司提供的担保承诺	83					
净资产金额	84				10,109,066,231.47	21,403,241,880.24

附1：期末或有事项

无

附2：其他需要特别说明的事项

无

注：1. 股票的分类中同时符合两个或两个以上标准的，应采用最高的比例进行扣减。

2. 证券投资基金不含货币市场基金。

3. 金融债券含国家开发银行、进出口银行、农业发展银行等政策性银行发行的金融债券及国际开发机构人民币债券。信用评级以长期信用评级为基准，短期信用评级A-1归入AAA级信用债券中，短期信用评级A-2、A-3归入AAA级以下、BBB级（含）以上的信用债券，短期信用评级B级（含）以下归入信用评级BBB级以下的信用债券。超短期融资券适用其发行主体的信用评级。未评级的信用债券归入BBB级以下信用债券。中小企业私募债券按照其信用评级确定其净资产扣减比例。

4. 信托产品投资由中国证监会按其评级、期限以及担保等情况确定其风险调整扣减比例。目前按80%比例进行风险调整。

5. 委托其他证券公司、基金公司的定向、专户等理财投资不含购买的集合理财计划及证券投资基金。

6. 按证监会根据审慎监管原则和有关投资的风险情况确定的比例进行调整。

7. 按证监会根据审慎监管原则和有关投资的风险情况确定的比例进行调整。

8. 融出证券除按融出证券市值5%扣减净资产外，还应根据融出证券所属自营股票的类别，按对应的折扣比例扣减净资产。

9. 分别按照约定购回式证券交易、股票质押式回购交易待购回交易金额的5%、10%扣减净资产。

10. 期货保证金是指已被股指期货、国债期货合约占用的交易保证金。

11. 其他业务子公司是指经批准或认可的从事直接投资、另类投资等业务的子公司。

12. 策略性股权投资是指经批准或认可的对证券公司、基金公司、期货公司、商业银行等机构的参股性投资。

13. 其他股权投资是指未经批准或认可的股权投资。

14. 购买固定资产等长期资产的预付款项应按照100%比例扣减净资产。

15. 按或有事项涉及金额的20%或可能发生的损失孰高者扣除。对于证券公司在债券承销过程中设置定向转让条款，约定投资者有权在一定时间内，将持有的部分或全部债券转让给承销商的，涉及的或有事项净资产扣除额在本行填列。

16. 指由中国证监会核准的其他允许计入净资产或从中扣除的项目。

17. 次级债计入净资产的具体比例在《证券公司次级债管理规定》（证监会公告[2012]51号）中规定。

18. 计算净资产时，需要计提资产减值准备的项目，以扣减资产减值准备后的净额作为计算基础；无须计提资产减值准备的项目，以其账面余额作为计算基础。

19. 流通受限的股票，指已发行尚未上市流通的新股、处于禁售期的法人股以及在一定期限内被锁定的股票。

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



风险控制指标监管报表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：元

项目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
净资本	1	10,109,066,231.47	21,403,241,880.24			
净资产	2	11,479,868,915.77	21,411,301,123.85			
净资本/各项风险资本准备之和	3	504.63%	688.93%	>120%	>100%	
净资本/净资产	4	88.06%	99.96%	>48%	>40%	
净资本/负债	5	28.15%	39.64%	>9.6%	>8%	
净资产/负债	6	31.99%	39.66%	>24%	>20%	
自营权益类证券及证券衍生品 注1 /净资本	7	27.74%	47.82%	<80%	<100%	
自营固定收益类证券/净资本	8	58.80%	53.73%	<400%	<500%	
持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名	9			<24%	<30%	
其中：委托证金公司投资	10		19.43%			
华宝华益十一号第一期	11		2.71%			
湘财稳健1号	12	4.23%	1.69%			
嘉实基金美元债资管计划	13		1.49%			
安信基金-工行-安信证券特定资产管理计划	14		1.23%			
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名 注2	15			<4%	<5%	
其中：500信息	16		21.51%			
恒康达	17		4.80%			
友泰电气	18		4.74%			
朗悦科技	19		4.19%			
软通股份	20		3.87%			
自有资金参与本公司单个集合计划的份额与总份额的比例前五名	21			<16%	<20%	
其中：安信证券安盈宝集合资产管理计划	22	19.98%	20.00%			
安信证券安发宝集合资产管理计划	23	19.99%	20.00%			
安信证券瑞安债券分级集合资产管理计划	24	19.46%	17.32%			
安信证券瑞享债券分级限额特定集合资产管理计划	25		16.71%			
安信证券瑞富债券分级限额特定集合资产管理计划	26		16.67%			
对单一客户融资规模与净资本的比例前五名	27			<4%	<5%	
其中：李永光	28		1.49%			
石庭波	29	2.94%	1.31%			
施彩练	30		1.07%			
朱韵	31		0.92%			
林穗贤	32		0.92%			
对单一客户融券规模与净资本的比例前五名	33			<4%	<5%	
其中：严亮佳	34		0.00%			
彭之浦	35		0.00%			
沈磊	36		0.00%			
费家乐	37		0.00%			

风险控制指标监管报表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：元

项目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
张展华	38		0.00%			
接受单只担保股票市值与该股票总市值比例前五名	39			<16%	<20%	
其中：兆日科技	40		7.19%			
厦门信达	41		5.55%			
金叶珠宝	42		2.72%			
三峡新材	43		2.58%			
荣丰控股	44		2.24%			

注：1. 包括股指期货、国债期货、利率互换等衍生品，其中股指期货投资规模以买入卖出股指期货合约价值总额的15%计算，国债期货投资规模以买入卖出国债期货合约价值总额的5%计算，利率互换投资规模以利率互换合约名义本金总额的3%计算。

2. 证券公司委托基金公司进行的特定单一客户投资和委托其他证券公司进行的定向理财投资不受“持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例不得超过5%”的限制，不必填报。自有资金参与本公司单个集合计划的份额与总份额的比例不在此填报。

3. “证券衍生品”包括权证、股指期货、国债期货、利率互换等；权益类证券具体包括：股票、股票基金、混合基金、集合理财产品、信托产品及证券公司委托基金公司、其他证券公司进行的证券投资（不含购买的证券投资基金、集合理财产品）；固定收益类证券具体包括：债券（含中小企业私募债券）、债券基金、央行票据、货币市场基金、资产证券化产品。

4. 表中有关前五名的期初数据，是指期末前五名情形所对应的期初数。

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人



风险资本准备计算表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：元

公司分类级别：A

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准					风险资本准备	
				连续3年为A	A	B	C	D	期初余额	期末余额
1. 经纪业务风险资本准备	1								129,246,132.68	192,970,579.13
其中：托管的客户交易资金总额	2	32,311,533,170.74	48,242,644,782.28	0.40%	0.60%	0.80%	2%	4%	129,246,132.68	192,970,579.13
2. 自营业务风险资本准备注1	3								175,339,406.80	492,835,834.95
其中：（1）证券衍生品投资规模	4	178,440,874.00	530,584,407.00						7,137,634.96	21,223,376.28
权证	5			4%	6%	8%	20%	40%		0.00
买入股指期货 注2	6	37,050,930.00	1,156,932.00	4%	6%	8%	20%	40%	1,482,037.20	46,277.28
卖出股指期货 注2	7	138,965,094.00	144,324,975.00	4%	6%	8%	20%	40%	5,558,603.76	5,772,999.00
买入国债期货 注2	8	1,208,825.00		4%	6%	8%	20%	40%	48,353.00	0.00
卖出国债期货 注2	9	1,216,025.00	7,552,500.00	4%	6%	8%	20%	40%	48,641.00	302,100.00
利率互换 注2	10		377,550,000.00	4%	6%	8%	20%	40%		15,102,000.00
其他	11			4%	6%	8%	20%	40%		
（2）权益类证券投资规模	12	2,552,316,295.17	9,652,734,106.55						76,569,488.85	289,582,023.20
股票	13	1,057,252,922.64	2,909,863,902.48	3%	4.50%	6%	15%	30%	31,717,587.68	87,295,917.07
股票基金	14	238,822,215.64	247,508,783.53	3%	4.50%	6%	15%	30%	7,164,666.47	7,425,263.51
混合基金	15	22,677,732.00	28,587,141.00	3%	4.50%	6%	15%	30%	680,331.96	857,614.23
集合理财产品	16			3%	4.50%	6%	15%	30%	-	0.00
信托产品	17	41,731,159.73	10,000,000.00	3%	4.50%	6%	15%	30%	1,251,934.79	300,000.00
其他	18	1,191,832,265.16	6,456,774,279.54	3%	4.50%	6%	15%	30%	35,754,967.95	193,703,228.39
（3）固定收益类证券投资规模	19	5,727,017,687.08	11,376,902,217.08						91,632,282.99	182,030,435.47
政府债券	20		635,917,590.00	1.60%	2.40%	3.20%	8%	16%		10,174,681.44
公司债券	21	5,503,262,608.16	8,708,761,614.83	1.60%	2.40%	3.20%	8%	16%	88,052,201.73	139,340,185.84
债券基金	22	167,755,078.92	48,570,668.88	1.60%	2.40%	3.20%	8%	16%	2,684,081.26	777,130.70
其他	23	56,000,000.00	1,983,652,343.37	1.60%	2.40%	3.20%	8%	16%	896,000.00	31,738,437.49
（4）已对冲风险的权益类证券及其衍生品投资规模 注3	24									
权益类证券	25			1%	1.50%	2%	5%	10%		
卖出股指期货 注2	26			1%	1.50%	2%	5%	10%		
其他衍生品	27			1%	1.50%	2%	5%	10%		
（5）已对冲风险的固定收益类证券及其衍生品投资规模 注3	28									
固定收益类证券	29			1%	1.50%	2%	5%	10%		
利率互换 注2	30			1%	1.50%	2%	5%	10%		
卖出国债期货 注2	31			1%	1.50%	2%	5%	10%		
其他衍生品	32			1%	1.50%	2%	5%	10%		
3. 承销业务风险资本准备	33								27,778,624.00	22,621,729.00

风险资本准备计算表

编制单位：安信证券股份有限公司

2015年12月31日

单位：元

公司分类级别：A

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准					风险资本准备	
				连续3年为A	A	B	C	D	期初余额	期末余额
其中：再融资项目股票承销业务规模	34			6%	9%	12%	30%	60%		
IPO项目股票承销业务规模	35		748,687,500.00	3%	4.50%	6%	15%	30%		22,460,625.00
公司债券承销业务规模 注4	36	1,600,000,000.00		1.60%	2.40%	3.20%	8%	16%	25,600,000.00	
政府债券承销业务规模 注5	37	272,328,000.00	20,138,000.00	0.80%	1.20%	1.60%	4%	8%	2,178,624.00	161,104.00
4. 资产管理业务风险资本准备	38								379,979,213.68	474,853,642.81
其中：专项理财业务规模	39		2,542,156,529.40	0.40%	0.60%	0.80%	2%	4%		10,168,626.12
集合理财业务规模	40	6,612,728,570.41	11,060,337,654.71	0.40%	0.60%	0.80%	2%	4%	26,450,914.28	44,241,350.62
限额特定理财业务规模	41	5,708,812,883.12	3,788,205,055.98	0.20%	0.30%	0.40%	1%	2%	11,417,625.77	7,576,410.11
定向理财业务规模	42	171,055,336,813.65	206,433,627,979.82	0.20%	0.30%	0.40%	1%	2%	342,110,673.63	412,867,255.96
5. 融资融券业务风险资本准备	43								271,297,026.86	276,453,561.96
其中：融资业务规模	44	26,764,434,174.08	27,642,806,539.61	1%	1.50%	2%	5%	10%	267,644,341.74	276,428,065.40
融券业务规模 注6	45	182,634,256.10	1,274,827.90	2%	3%	4%	10%	20%	3,652,685.12	25,496.56
6. 分支机构风险资本准备	46								708,000,000.00	1,254,000,000.00
其中：分公司家数 注7	47	9.00	36.00	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2	180,000,000.00	720,000,000.00
营业部家数 注7	48	176.00	178.00	0.03	0.03	0.03	0.03	0.03	528,000,000.00	534,000,000.00
7. 营运风险资本准备	49								201,233,392.23	284,836,097.96
其中：上一年度营业费用 注8	50	2,012,333,922.31	2,848,360,979.61	10%	10%	10%	10%	10%	201,233,392.23	284,836,097.96
8. 其他风险资本准备	51	3,668,616,483.28	3,581,269,296.61						110,381,183.69	108,171,298.73
其中：中小企业私募债券 注9	52	216,640,292.29	122,926,926.82	3%	4.50%	6%	15%	30%	6,499,208.77	3,687,807.80
约定购回式证券交易 注10	53	13,498,263.11	35,424,146.00	2%	3%	4%	10%	20%	269,965.26	708,482.92
股票质押式回购交易 注10	54	3,448,938,711.78	1,744,132,673.57	3%	4.50%	6%	15%	30%	100,168,161.35	52,323,980.21
各项风险资本准备之和	55								2,003,254,979.94	3,106,742,744.54

附：本风险资本准备计算表内的期末风险资本准备按分类级别连续三年为A的证券公司计算标准计算各项风险资本准备。

注：1. 证券衍生品包括权证、股指期货、国债期货、利率互换等；权益类证券具体包括：股票、股票基金、混合基金、集合理财产品、信托产品及证券公司委托基金公司、其他证券公司进行的证券投资；固定收益类证券具体包括：债券、债券基金、央行票据、货币市场基金、资产证券化产品。

2. 股指期货投资规模以买入卖出股指期货合约价值总额的15%计算，国债期货投资规模以买入卖出国债期货合约价值总额的5%计算，利率互换投资规模以利率互换合约名义本金总额的3%计算。

3. 股指期货、国债期货、利率互换套期保值满足《企业会计准则第24号—套期保值》有关套期保值高度有效要求的，可认为已对冲风险。

4. 公司债券是指以公司为发行人的公司债、企业债、可转债、短期融资券、中期票据等。

5. 政府债券是指以政府为发行人的债券。

6. 融券业务规模按照融出时证券的市值计算。

7. 每家分公司、营业部按0.2亿元、0.03亿元计算风险资本准备，风险资本准备期初期末余额应以元为单位填列。

8. 营业费用指业务及管理费、资产减值损失、其他业务成本之和。

9. 证券公司承销、自营业务参与中小企业私募债券的，应分别按照15%的比例计算承销业务、自营业务风险资本准备（15%为基准比例，不同类别公司按规定实施不同的计算比例）。

10. 证券公司开展约定购回式证券交易、股票质押式回购交易，分别按照待购回交易金额的10%、15%计算风险资本准备（10%、15%为基准比例，不同类别公司按规定实施不同的计算比例）。

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



净资本监管报表说明

一、 公司基本情况

安信证券股份有限公司（以下简称“本公司”）是由中国证券投资者保护基金有限责任公司、深圳市投资控股有限公司共同出资，于 2006 年 8 月 18 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）证监机构字[2006]197 号文《关于同意安信证券股份有限公司开业的批复》批准成立的综合类证券公司。2006 年 8 月 22 日领取深圳市工商行政管理局核发的注册号为 440301103553444 的企业法人营业执照。本公司法定代表人：牛冠兴；经营证券业务许可证编号：13660000；本公司总部位于深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元；成立时注册资本人民币 151,000 万元。注册资本已经中审会计师事务所审验并出具中审验字[2006]第 6009 号验资报告。

于 2006 年 9 月及 12 月本公司分别受让原广东证券股份有限公司、原中国科技证券有限责任公司及原中关村证券股份有限公司（以下合并简称“原三家证券公司”）的证券经纪类相关业务。

于 2009 年 8 月 26 日，经证监会《关于核准安信证券股份有限公司变更注册资本的批复》（证监许可[2009]857 号）批准增加注册资本人民币 87,975 万元；该增资部分已经中审亚太会计师事务所审验并出具中审亚太审字(2009)第 010486 号验资报告。

于 2011 年 8 月 9 日，经证监会《关于核准安信证券股份有限公司变更注册资本的批复》（证监许可[2011]1247 号）批准由未分配利润转增注册资本人民币 43,565 万元；该转增部分已经安永华明会计师事务所审验并出具安永华明(2011)验字第 60884100_B01 号验资报告。此次转增后，本公司注册资本为人民币 282,540 万元。

于 2012 年 8 月 30 日，经证监会《关于核准安信证券股份有限公司变更注册资本的批复》（证监许可[2012]1164 号）批准由未分配利润转增注册资本人民币 37,459 万元；该转增部分已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具安永华明(2012)验字第 60884100_H01 号验资报告。截至 2014 年 12 月 31 日，本公司注册资本为人民币 319,999 万元。

2013 年度，经证监会《关于中国证券投资者保护基金公司退出持有安信证券股权方案有关事宜的函》、财政部财金函[2013]111 号以及深圳证监局深证局许可字[2013]188 号批准，国家开发投资公司受让中国证券投资者保护基金有限责任公司持有的本公司 183,214 万股股权，占本公司总股本比例为 57.25%。

2014 年度，经深圳证监局深证局机构字[2014]3 号批准，北京浩成投资管理有限公司受让哈尔滨工业大学八达集团有限公司持有的本公司 873 万股股份，占本公司总股本比例为 0.27%；哈尔滨益辉咨询有限公司受让哈尔滨工业大学八达集团有限公

司持有的本公司 2,150 万股股份，占本公司总股本比例为 0.67%。经深圳证监局深证局机构字[2014]26 号批准，国家开发投资公司受让浙江金桥创业投资有限公司、北京友成资产管理有限公司、北京中金国科创业投资管理有限公司持有的安信证券股份有限公司 2,409 万股股份，占本公司总股本比例为 0.75%。完成上述股份转让后，国家开发投资公司持有本公司股本比例为 58.01%。

2015 年 1 月 30 日，中纺投资发展股份有限公司（以下简称“中纺投资”）发行股份购买本公司资产的重大资产重组事宜已经中国证监会核准。于 2015 年 2 月 13 日，重大资产重组事项已完成 100%股份的过户手续及相关工商备案登记事宜。本次股权变更后，股东由原来国家开发投资公司等 14 家公司变更为中纺投资（持股 99.9969%）及中纺投资之全资子公司上海毅胜投资有限公司（以下简称“毅胜投资”，持股 0.0031%）。

2015 年 3 月 23 日，经本公司 2015 年第四次临时股东大会决议通过，同意本公司股东中纺投资及毅胜投资以货币资金人民币 6,047,638,130.50 元对本公司增资，增加注册资本人民币 325,141,834.00 元。此次增资完成后，本公司总股本增加至 3,525,134,979 股，其中：中纺投资持有本公司 3,525,024,819 股股份，占本公司总股本比例为 99.9969%；毅胜投资持有本公司 110,160 股股份，占本公司总股本比例为 0.0031%。上述增资已于 2015 年 3 月 26 日完成，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具安永华明(2015)验字第 60884100_H02 号验资报告。

本公司经营范围为：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，为期货公司提供中间介绍业务，代销金融产品及中国证监会批准的其他证券业务。

本公司的母公司为中纺投资，2015 年 5 月更名为国投安信股份有限公司（以下简称“国投安信”）。本公司的最终控制方为国家开发投资公司。

二、 编制基础

本净资产计算表、风险控制指标监管报表、风险资本准备计算表及其报表附注是根据中国证监会颁布的《证券公司风险控制指标管理办法》（中国证监会第 55 号令）、《关于调整证券公司净资产计算标准的规定》（中国证监会公告[2012]37 号）、《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》（中国证监会公告[2008]28 号）、《关于修改〈关于证券公司风险资本准备计算标准的规定〉的决定》（中国证监会公告[2012]7 号）、《关于修改〈关于证券公司风险资本准备计算标准的规定〉的决定》（中国证监会公告[2012]36 号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第 1 号—股指期货、融资融券》（深证局机构字[2010]161 号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第 2 号—证券

自营业务》（深证局机构字[2011]92号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第5号—参与转融通业务》（中国证监会机构部部函[2012]653号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第6号—三项回购业务》（中国证监会机构部部函[2013]551号）、《证券公司风控指标监管报表编报指引第7号—参与股指期货、国债期货交易》（中国证监会机构部部函[2013]930号）、《关于开展上市公司股权激励行权融资业务和限制性股票融资业务试点监管工作安排的通知》（中国证监会证券基金机构监管部部函[2014]393号）、《关于做好证券公司私募基金综合托管业务和客户资金消费支付服务监管工作的函》（中国证监会证券基金机构监管部部函[2014]1172号）、《关于证券公司场外股权衍生品业务风控指标计算等事项的复函》（中国证监会证券基金机构监管部部函[2014]1621号）的规定，以本公司按财政部颁布及修订的企业会计准则（包括基本准则、具体准则、应用指南和其他相关规定）编制的2015年度财务报表及有关财务会计记录为基础而编制的。



此证复印件仅作为报告附件使用，
不能作为他用。



营业执照

(副本)

注册号 310101000439673

证照编号 01000000201504200097

名称 立信会计师事务所(特殊普通合伙)

类型 特殊的普通合伙企业

主要经营场所 上海市黄浦区南京东路61号四楼

执行事务合伙人 朱建弟

成立日期 2011年1月24日

合伙期限 2011年1月24日至不约定期限

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。

【企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营】



登记机关



2015年 04月 20日



证书序号: NO. 017271

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, 应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



发证机关: 上海市财政局

二〇一四年八月五日

中华人民共和国财政部制



此证复印件仅作为报告书附件使用, 不能作为他用。

会计师事务所 执业证书

名称: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)

主任会计师: 朱建弟

办公场所: 上海市黄浦区南京东路6号西楼

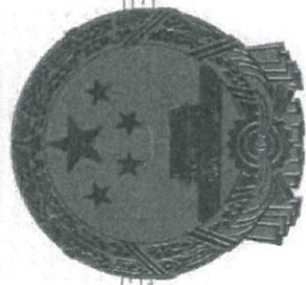
组织形式: 特殊普通合伙企业

会计师事务所编号: 31000006

注册资本(出资额): 人民币9550万元整

批准设立文号: 沪财会(2000)26号 (财会发[2000]87号)

批准设立日期: 2000年6月13日 (总局日期: 2010年7月2日)



证书序号: 000373

此证复印件仅作为报告附件使用，
不能作为他用。

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

立信会计师事务所（特殊普通合伙） 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人：朱建弟



证书号：34

发证时间：二〇一七年七月十九日

证书有效期至：二〇一七年七月十九日



THE CHINESE INSTITUTE OF CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS
中国注册会计师协会

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: 11000121001
注册证号: 00322000
发证日期: 2012年5月8日

姓名: 许培楠
性别: 女
出生日期: 1975.8.2
工作单位: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)
身份证号码: 37083319750802244

2012.5.8

立信 会计师事务所(特殊普通合伙)
立信
会计师事务所
(特殊普通合伙)

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.

注册日期: 2012年12月20日

2012.12.20

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.

注册日期: 2012年12月20日

2012.12.20



THE CHINESE INSTITUTE OF CERTIFIED PUBLIC ACCOUNTANTS
中国注册会计师协会

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

同意变更
Agree the holder to be transferred from

姓名
Full Name 高红娜

性别
Sex 女

出生日期
Date of Birth 1976-03-15

工作单位
Working Unit 立信会计师事务所有限公司

身份证号码
Identity No. A18423197603150023

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.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

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

同意变更
Agree the holder to be transferred from

姓名
Full Name 高红娜

性别
Sex 女

出生日期
Date of Birth 1976-03-15

工作单位
Working Unit 立信会计师事务所有限公司

身份证号码
Identity No. A18423197603150023

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.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.

年度检验合格
This certificate is valid for this renewal.