

安信证券股份有限公司

风险控制指标专项审计报告

信会师报字[2017]第 ZG10779 号

安信证券股份有限公司
风险控制指标专项审计报告

2016 年 12 月 31 日

	目 录	页 次
一、	审计报告	1-2
二、	净资本计算表	1
	风险资本准备计算表	2
	表内外资产总额计算表	3
	流动性覆盖率计算表	4
	净稳定资金率计算表	5
	风险控制指标监管报表	6
	风险控制指标监管报表说明	1-3



审 计 报 告

信会师报字[2017]第 ZG10779 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 2016 年 12 月 31 日净资本计算表、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、风险控制指标监管报表及其说明（以下统称“风险控制指标监管报表”）。

一、管理层对风险控制指标监管报表的责任

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》、《证券公司风险控制指标计算标准规定》等规定，以及相关编报指引的要求编制和公允列报风险控制指标监管报表，并负责设计、实施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风险控制指标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风险控制指标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，以获取有关风险控制指标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风险控制指标监管报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与风险控制指标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，以及评价风险控制指标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 2016 年 12 月 31 日风险控制指标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》、《证券公司风险控制指标计算标准规定》等规定，以及相关编报指引的要求编制。

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：

张梅
10002470001

中国注册会计师：

王红娜
11010590038

二〇一七年三月二十九日

净资产计算表

编制单位：安信证券股份有限公司

2016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	21,411,301,123.85	21,262,138,552.71		21,411,301,123.85	21,262,138,552.71
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	4,827,479,815.43	6,862,063,467.87		4,489,469,213.30	5,523,067,643.19
存出保证金	4	535,341,659.73	1,596,487,526.79		197,331,057.60	257,491,702.10
其中：履约保证金	5	56.04	1,301,329,841.01	10%	5.60	130,132,984.10
期货保证金注1	6	197,331,052.00	127,358,718.00	100%	197,331,052.00	127,358,718.00
其他存出保证金	7					
长期股权投资	8	3,158,159,806.80	3,672,436,337.83	100%	3,158,159,806.80	3,672,436,337.83
投资性房地产、固定资产注2	9	304,083,526.79	396,298,775.04	100%	304,083,526.79	396,298,775.04
其他注3	10	829,894,822.11	1,196,840,828.21	100%	829,894,822.11	1,196,840,828.22
减：或有负债的风险调整合计	11					
对外担保金额及担保承诺注4	12			100%		
其他或有负债注5	13			100%		
加：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计注6	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注6	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					
核心净资产	20	16,583,821,308.42	14,400,075,084.84		16,921,831,910.55	15,739,070,909.52
加：附属净资产注7	21	22,499,088,376.74	15,999,829,767.95		8,399,842,869.38	999,983,489.99
借入的次级债（含永续次级债）注8	22	22,499,088,376.74	15,999,829,767.95		8,399,842,869.38	999,983,489.99
中国证监会认定或核准的其他调整项目注9	23					
净资产注10	24				25,321,674,779.93	16,739,054,399.51
附1：期末或有事项						
附2：其他需要特别说明的事项						

注：

1. 期货保证金是指已被股指期货、国债期货、商品期货等合约占用的交易保证金。
2. 固定资产包括所有权属明确的房产及其他固定资产。
3. 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、转持承销费用、抵债资产、长期待摊费用等其他资产，例如购买固定资产等长期资产的预付款项等。持有的金融资产不扣减净资产。
4. 对外担保金额不包括公司为自身负债提供的反担保。担保承诺指对控股证券业务子公司提供的担保承诺。
5. 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，以及证券公司为境外子公司融资提供的担保涉及的或有事项净资产扣除项在本行填列。
6. 指由中国证监会认定或核准的可计入核心净资产或需从核心净资产中扣除的项目。
7. 附属净资产不得超过核心净资产。
8. 次级债计入净资产的具体比例参照中国证监会的相关规定。
9. 指由中国证监会认定或核准的可计入附属净资产的项目，包括优先股、应急可转债等。
10. 净资产为核心净资产和附属净资产之和。
11. 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。

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



编制单位：安信证券股份有限公司

2016年12月31日

单位: 元

注:

1. 权益类证券及其衍生品包括：股票、权益类基金、股指期货、权益互换、期权等。非权益类证券及其衍生品包括：债券、非权益类基金、国债期货、债券远期、利率互换、外汇衍生品、定向、集合及信托等产品、大宗商品现货和衍生品等。

2. 一般上市股票包含非市场股票, 优先股以及在国内外证券交易所挂牌的中概市并持股票市值与该股票市值比例高于5%的部分, 而受限的股票包含未上市流通、限制流通以及流动性较低的股票, 具体指已发行尚未上市流通的新股、处于限售期的法人股、在一定期限内被锁定的股票以及在国内外证券交易所挂牌的股份 (包含中概市并持股票市值与该股票市值比例高于5%的部分), 其他股票包含ST股票、*ST股票。已退市股票和持有市值与该股票市值的比例超过5%的股票, 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计算。股票不会转融通融入的证券

* 权益类基金包括股票型基金、混合型基金。权益类ETF和分级基金由非代售基金合同、分级基金中非代售基金指分级基金中除代售份额之外的基金份额。

3. 权益类资产包括股票基金、混合基金、权益类ETF和分级基金中非优先基金等。分级基金中非优先基金指分级基金中除优先份额之外份额资产。4. 股指期货、国债期货、债券远期、大宗商品衍生品投资规模分别按该合约名义价值总额的10%、3%、50%和3%计算。权益互换、利率互换、外汇衍生品投资规模按照买入股票期权和买入场外期权的权利金价格之和计算。

算, 卖出股票期权投资规模按照Delta金额的15%计算, 期权的Delta金额根据交易所公布的Delta系数进行计算, 卖出场外期权投资规模按照该期权在给定压力情形下的最大损失的5倍计算, 且不低于名义金额的5%。给定压力情形为期权标的证券价格以当前价格为基础, 上下波动20%。

5. 政策性金融债指进出口银行、农业发展银行等政策性银行发行的金融债券，政府支持机构债券为得到中央政府正式支持发行的债券，如中国铁路总公司发行的获得中央政府支持的铁路建设债券等。地方政府债为地方政府作为发行主体发行的债券，信用评级以长期信用评级为基准，短期信用评级A-1进入AAA级信用评级中，短期信用评级A-2进入AAA级以下，AA级（含）以上信用评级A-3进入AAA级以下信用评级中，短期信用评级A-3进入AAA级以下信用评级中。

期信用评级A+归入AAA级信用债券中，短期信用评级A-归入AAA级以下，AAA级（含）以上信用债券中，短期信用评级A+归入AAA级以下，BBB级（含）以上的信用债券中，短期信用评级B级（含）以下归入信用评级BBB级以下的信用债券中。未评级的信用债券参照 债券发行主体评级，发行主体无评级的归入BBB级以下信用债券。债券信用评级信息以中央国债登记结算有限责任公司公布的信息为准。 可转债、

6. 非权益类基金包括货币基金、分级基金中优先级基金、债券基金、黄金ETF等，集合及信托等产品指证券公司持有的证券公司集合资产管理计划、商业银行理财产品及信托产品等集合类产品，定向产品指证券公司委托其他证券公司、基金公司、信托公司等机构进行的一对一投资。

2. 符合以下条件的可认为已对冲风险：（1）投资组合中的标的一致，或相关标的过去一年价格相关系数不低于95%；（2）投资组合中相关投资 为对冲目的而持有；（3）投资组合中的多头Delta或DV01绝对值与空头Delta或DV01绝对值的比例处于80%-125%之间。投资规模为多头规模 的绝对值及空头规模的绝对值，衍生品多头规模、空头规模计算方法参照附注4。

8. 融资类业务包括融资融券业务、约定购回业务和股票质押回购业务等。其中，融券业务规模按照融出证券的市值计算，场内融资业务特指在证券交易所开展的股票质押等融资类业务，场外融资业务主要指在柜台市场、机构间市场开展的股票质押等融资类业务（新三板股票质押融资比照场外计算）。

9. 证券经纪业务、证券投资咨询业务、证券承销与保荐业务、财务顾问业务、证券资产管理业务的净收入以及其他业务净收入，为近三个年度 利润监管报表相应科目余额的平均数。证券自营业务净收入为近三个年度利润监管报表“交易性金融工具的投资收益、可供出售金融资产的 投资收益、持有至到期金融资产的投资收益、衍生金融工具的投资收益、交易性金融工具公允价值变动收益、衍生金融工具公允价值变动收益”科目余额之和的平均数；若证券自营业务净收入为负，则按上一年来自自营业务证券投资成本的3%计算，融资融券净收入为近三个年度利润监管 报表“融购

10. 资产管理业务按照接受委托管理资产净值计算, 投资非标资产的定向资产管理计划按照计划投资金额扣除票据、信托、理财产品、各类收益权 等未在银行间市场和公开证券交易所交易的股权、债权及其他附产权利的资产,

12. 分拆调整前的各项风险资本准备合称为市场风险资本准备、信用风险资本准备、操作风险资本准备及特定风险资本准备各计算结果之和。

13. 各类证券公司风险资本准备根据分类评价结果进行调整, 系数为: 连续三年A类为0.7, A类为0.8, B类为0.9, C类为1, D类为2, C类为基准。

100

一、省、市、自治区、地、县、市、区、镇、乡、村、组、户、人、口、数、目、表、册、

法定代表人: _____ 主管会计工作负责人: _____ 会计机构负责人: _____

建 工 印 成

生

1000

100

第 2 页

表内外资产总额计算表

编制单位: 安信证券股份有限公司

2016年12月31日

单位: 元

项目	行次	期末余额	转换系数	计算结果
表内资产总额 注1	1	97,737,229,827.86	100%	97,737,229,827.86
减: 表内资产扣除项	2	30,510,438,665.77		30,510,438,665.77
1. 客户资金	3	30,510,438,665.77		30,510,438,665.77
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	30,364,593,880.24	100%	30,364,593,880.24
其他	5	145,844,785.53	100%	145,844,785.53
表内资产余额	6	67,226,791,162.09		67,226,791,162.09
表外项目				
1. 证券衍生产品 注2	7	933,021,397.79		933,021,397.79
国债期货、债券远期及利率互换	8	819,621,525.00	100%	819,621,525.00
股指期货、权益互换及卖出股票期权	9	93,005,496.00	100%	93,005,496.00
大宗商品衍生品	10		100%	
卖出场外期权	11	20,394,376.79	100%	20,394,376.79
其他	12			
2. 资产管理业务 注3	13	335,879,438,936.58	0.2%	671,758,877.87
3. 其他表外项目	14	291,285,538.13		81,654,928.13
转融通融入证券 注4	15	95,535,100.00	10%	9,553,510.00
股票再融资承销承诺 注5	16		15%	
股票IPO承销承诺 注5	17	137,387,800.00	10%	13,738,780.00
债券承销承诺 注5	18		5%	
对外担保金额及担保承诺 注6	19		100%	
其他或有事项 注7	20	58,362,638.13	100%	58,362,638.13
表外项目余额 注8	21			1,686,435,203.79
表内外资产总额 注9	22			68,913,226,365.88

注:

1. 表内资产总额为资产负债表中的总资产。
2. 国债期货、债券远期、利率互换、外汇衍生品、股指期货、权益互换、大宗商品衍生品期末余额分别按照合约名义价值总额的5%、50%、3%、3%、15%、10%、15%计算。卖出股票期权期末余额按照Delta金额的15%计算。期权的Delta金额根据交易所公布的Delta系数进行计算。卖出场外期权期末余额按照该期权在给定压力情形下的最大损失的5倍计算,且不低于名义金额的5%,给定压力情形为期权标的证券价格以当前价格为基础上下波动20%。多头与空头不允许净轧差。
3. 含各类私募投资基金(含各类直投基金),即证券公司控股的从事私募证券投资及私募股权投资业务的子公司开展的各项私募投资基金,包括各类直投基金(含合伙制)、并购基金等。
4. 转融通融入证券按照其期末市值计算。
5. 股票再融资项目、IPO项目、债券项目承销承诺自网上申购日(或发行日期)前3天开始计算至发行期结束日止。若在此期间之前已经签署承销团协议的,期末余额按照各主承销商及分销商承诺包销的金额填列;若在此期间之前没有签署承销团协议的,期末余额按照各主承销商承诺包销的金额填列。若承销协议没有约定各主承销商承诺包销的金额,按总包销金额平均分配到各主承销商填列。
6. 对外担保金额不包括公司为自身负债提供的反担保;担保承诺指对控股证券业务子公司提供的担保承诺。
7. 其他或有事项包括但不限于资本性支出承诺、投资承诺、或有负债、未决诉讼赔偿及其他各类承诺事项等。按或有事项涉及金额的或可能发生的损失孰高者计算。
8. 表外项目余额为证券衍生产品、资产管理业务及其他表外项目计算结果合计。
9. 表内外资产总额为表内资产余额与表外项目余额合计。

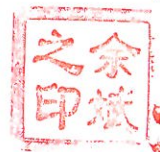
法定代表人



主管会计工作负责人:



会计机构负责人:



净稳定资金率计算表

填报单位:安信证券股份有限公司

2016年12月31日

单位:元

项目	序号	期末金额	折算率	折算后金额
可用稳定资金	1			36,914,026,811.22
其中: 1. 净资产	2	21,262,138,552.71	100%	21,262,138,552.71
2. 剩余存续期大于等于1年的借款和负债	3			15,651,888,258.51
短期借款	4	1,999,966,979.97	100%	1,999,966,979.97
长期借款	5	570,000,000.00	100%	570,000,000.00
应付债券	6	8,081,921,278.54	100%	8,081,921,278.54
其他注1	7	5,000,000,000.00	100%	5,000,000,000.00
3. 所有其他负债和权益	8	28,821,325,339.97	0%	
所需稳定资金	9			25,180,743,093.12
其中: 1. 高流动性资产	10			
货币资金注2	11	4,631,721,018.27	0%	
结算备付金	12	1,385,168,518.02	0%	
拆出资金(不足1年)	13		0%	
存出保证金	14	1,556,070,176.47	0%	
买入返售金融资产注3	15	2,039,242,101.77	0%	
货币基金	16	3,650,849,324.19	0%	
2. 剩余存续期不足1年的证券注4	17			12,430,821.00
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	1,204,050,600.00	0%	
信用评级AAA级的信用债券	21	354,861,050.00	0%	
信用评级AAA级以下, AA级(含)以上的信用债券	22	388,477,500.00	1%	3,884,775.00
信用评级AA级以下, BBB级(含)以上的信用债券	23	50,221,300.00	3%	1,506,639.00
信用评级BBB级以下的信用债券	24	140,788,140.00	5%	7,039,407.00
3. 剩余存续期大于等于1年证券注4	25			1,081,804,889.76
国债、中央银行票据、国开债	26	535,168,360.00	5%	26,758,418.00
政策性金融债、政府支持机构债券	27	389,644,200.00	5%	19,482,210.00
地方政府债	28	886,091,800.00	5%	44,304,590.00
信用评级AAA级的信用债券	29	1,819,100,258.89	10%	181,910,025.89
信用评级AAA级以下, AA级(含)以上的信用债券	30	3,643,855,924.36	20%	728,771,184.87
信用评级AA级以下, BBB级(含)以上的信用债券	31	50,312,920.00	30%	15,093,876.00
信用评级BBB级以下的信用债券	32	130,969,170.00	50%	65,484,585.00
4. 股票注5	33			2,941,543,587.40
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	34	493,200,310.65	30%	147,960,093.20
一般上市股票	35	4,868,690,355.27	50%	2,434,345,177.64
流通受限的股票及其他股票	36	359,238,316.56	100%	359,238,316.56
5. 可转换债券	37		30%	
6. 衍生金融资产	38	23,608.33	0%	
7. 证券投资基金注6	39			29,209,476.61
非权益类基金	40	31,056,316.40	10%	3,105,631.64
权益类基金	41	130,519,218.93	20%	26,103,843.79
其中: 分级基金中非优先级基金	42	2.36	50%	1.18
8. 其他现金管理类资产注7	43		20%	
9. 融出资金	44			8,768,896,272.91
自有资金融出资金	45	16,937,792,545.82	50%	8,468,896,272.91
转融通融出资金	46	6,000,000,000.00	5%	300,000,000.00
10. 约定购回融出资金	47	11,033,072.31	50%	5,516,536.16
11. 股票质押式回购融出资金	48			1,785,590,333.57
到期日在1年以内(含)的融出资金	49	2,580,285,622.52	50%	1,290,142,811.26
到期日在1年以上(不含)的融出资金	50	660,596,696.41	75%	495,447,522.31
12. 1年以内的应收款项、应收股利、应收利息	51	1,118,533,300.37	50%	559,266,650.19
13. 其他所有资产注8	52	9,708,703,113.72	100%	9,708,703,113.72
14. 表外项目	53			287,781,411.80
14.1 证券衍生品	54			274,042,631.80
利率互换注9	55	26,975,000,000.00	0.5%	134,875,000.00
国债期货及债券远期注10	56	207,430,500.00	3%	6,222,915.00
股指期货注11	57	1,107,872,640.00	12%	132,944,716.80
14.2 其他表外项目	58			13,738,780.00
股票再融资承销承诺注12	59		15%	
股票IPO承销承诺注12	60	137,387,800.00	10%	13,738,780.00
债券承销承诺注12	61		5%	
对外担保金额及担保承诺注13	62		5%	
其他或有事项	63		5%	
净稳定资金率(NSFR)注14	64			146.00%

- 注:
- 指有相关法规、合同、公司股东大会决议等法律文件明确其剩余存续期大于等于一年,且债权人无权要求公司提前偿还的债务。
 - 不包括代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款以及代理承销证券款。
 - 不含约定购回和股票质押式回购融出的资金。
 - 政策性金融债指进出口银行、农业发展银行等政策性银行发行的金融债券,政府支持机构债券为得到中央、地方政府正式支持发行的债券,如中国铁路总公司发行的获得中央政府支持的铁路建设债券等,地方政府债为地方政府作为发行主体发行的债券,信用评级以长期信用评级为准。短期信用评级A-1至AAA级信用债券中,短期信用评级A-2至AAA级以下,AA级(含)以上信用债券中,短期信用评级A-3至AAA级以下,BBB级(含)以上的信用债券中,短期信用评级BBB级(含)以下纳入信用评级BBB级以下的信用债券中,未评级的信用债券参照债券发行主体评级,发行主体无评级的纳入BBB级以下信用债券。债券信用评级信息以中央国债登记结算有限责任公司公布的信息为准。
 - 一般上市股票指在境外上市股票、优先股以及在金融系统系统挂牌的中外上市股票且其股票市值与净资产市值比例高于5%的部分。流通受限的股票指限售流通股、限售流通股、处于停牌状态的股票、处于停牌状态的股票、在一定期限内被锁定的股票以及在金融系统系统挂牌的股票(包含在上市且其股票市值与净资产市值比例高于5%的部分)。其他股票包含ST股票、*ST股票、已退市股票和持有市值与净资产市值比例高于5%的股票。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计算。股票不按照转融通融入的证券。
 - 证券投资基金不含货币基金。
 - 指一个月内可赎回或到期其他现金管理产品。
 - 不含代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、代理承销证券款及转融通融入证券形成的资产。
 - 利率互换、外汇衍生品期末金额按名义价值总额列。
 - 国债期货、债券远期期末金额按名义价值总额列。
 - 股指期货期末金额按名义价值总额列。
 - 股票质押式回购融出资金指在1年以内(含)或1年以上(不含)的融出资金,若在此期间内已经签署承销团协议的,期末余额按照各承销商及分承销商承销的金额列;若在此期间内没有签署承销团协议的,期末余额按照各承销商承销的金额列。若承销协议没有约定各承销商承销的金额,按各承销商平均分配各承销商承销的金额。
 - 对外担保金额不包括公司为自身负债提供的反担保;担保承诺指对控股证券业务子公司提供的担保承诺。
 - 净稳定资金率=可用稳定资金/所需稳定资金=100%。

法定代表人:

连志

主管会计工作负责人:

省楊印成

会计机构负责人:

之余印斌

风险控制指标监管报表

编制单位：安信证券股份有限公司

2016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
核心净资本	1	16,921,831,910.55	15,739,070,909.52			
附属净资本	2	8,399,842,869.38	999,983,489.99			
净资本	3	25,321,674,779.93	16,739,054,399.51			
净资产	4	21,411,301,123.85	21,262,138,552.71			
各项风险资本准备之和	5	8,077,980,884.49	8,951,787,036.94			
表内外资产总额	6	76,451,229,111.68	68,913,226,365.88			
风险覆盖率注1	7	313.47%	186.99%	≥120%	≥100%	
资本杠杆率注2	8	22.13%	22.84%	≥9.6%	≥8%	
流动性覆盖率注3	9	419.35%	199.97%	≥120%	≥100%	
净稳定资金率注4	10	142.56%	146.60%	≥120%	≥100%	
净资本/净资产	11	118.26%	78.73%	≥24%	≥20%	
净资本/负债	12	46.91%	36.42%	≥9.6%	≥8%	
净资产/负债	13	39.66%	46.26%	≥12%	≥10%	
自营权益类证券及其衍生品注5/净资本	14	29.23%	35.79%	≤80%	≤100%	
自营非权益类证券及其衍生品注6/净资本	15	60.80%	107.07%	≤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					
委托证券公司投资	18	16.43%	24.85%			
安信基金-工行-安信证券特定资产管理计划	19	1.04%	4.56%			
300166 东方国信	20	0.00%	2.15%			
嘉实基金-安信证券海外美元债资产管理计划	21	1.26%	1.91%			
安信基金农业银行安信证券2号资产管理计划	22	0.00%	1.49%			并列第五名情况：756162_安信基金农行安信证券2号资产管理计划期末成本与净资本的比例为1.49%
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名注7	23			≤4%	≤5%	
其中：	24					
300166_东方国信	25	0.00%	2.40%			代码为837293、831462、832527、831322及831965的五只股票是在全国中小企业股份转让系统开展的做市业务。
002837_华夏网购精选混合	26	0.00%	1.92%			对应的集中度为：5.31%、4.76%、4.32%、4.19%、及4.00%。
003333 泰信智选成长混合	27	0.00%	1.72%			
510510 广发300	28	0.73%	1.16%			
000860 顺鑫农业	29	1.92%	0.62%			
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8	30			≤16%	≤20%	
其中：	31					
安信证券荣享集合资产管理计划	32	4.00%	19.95%			因持有券延期偿还本息，该账户目前等待二次清算。
安信证券瑞安债券分级集合资产管理计划	33	17.32%	17.32%			该产品成立时，自有资金参与严格按照法律、行政法规和中国证监会的规定参与。
安信证券瑞泽债券分级限额特定集合资产管理计划	34	16.67%	16.68%			该产品成立时，自有资金参与严格按照法律、行政法规和中国证监会的规定参与。
安信证券瑞富债券分级限额特定集合资产管理计划	35	16.67%	16.68%			该产品成立时，自有资金参与严格按照法律、行政法规和中国证监会的规定参与。
安信证券瑞和债券分级限额特定集合资产管理计划	36	16.67%	16.67%			该产品成立时，自有资金参与严格按照法律、行政法规和中国证监会的规定参与。
融资（含融券）的金额/净资本注9	37	116.39%	156.87%	≤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	38			≤4%	≤5%	
其中：	39					
徐佳东	40	0.79%	2.18%			
金龙控股集团有限公司	41	0.95%	1.79%			
沈于蓝	42	0.00%	1.79%			
深圳国安科能投资管理有限公司	43	0.00%	1.67%			
李永光	44	1.26%	1.63%			
接受单一担保股票市值与该股票总市值比例前五名注11	45			≤16%	≤20%	
其中：	46					
000153 丰原药业	47	0.10%	6.01%			
300333 兆日科技	48	7.19%	5.79%			
600506 香梨股份	49	1.94%	4.92%			
000790 泰合健康	50	0.00%	3.39%			
000823 超声电子	51	0.80%	2.98%			

- 注：
1. 风险覆盖率=净资本/各项风险资本准备之和×100%
 2. 资本杠杆率=核心净资本/表内外资产总额×100%。此处核心净资本不扣除担保等或有负债的风险调整。
 3. 流动性覆盖率=优质流动性资产/未来30日内现金净流出×100%
 4. 净稳定资金率=可用稳定资金/所需稳定资金×100%
 5. “自营权益类证券及其衍生品”包括：股票、权益类基金、股指期货、权益互换、期权等。其中，自营权益类证券按照其市值计算；股指期货投资规模按照合约名义价值总额的15%计算；权益互换投资规模按照合约名义价值总额的10%计算；买入期权投资规模按照买入股票期权和买入场外期权的权利金之和计算；卖出股票期权投资规模按照Delta金额的15%计算；卖出场外期权投资规模按照该期权在给定压力情形下的最大损失的5倍计算，且不低于名义金额的5%。给定压力情形为期权标的证券价格以当前价格为基础上下波动20%。对于已有效对冲风险的投资组合，按投资规模总额的5%计算，投资规模为多头规模的绝对值与空头规模的绝对值之和。
 6. “自营非权益类证券及其衍生品”包括：债券、非权益类基金、国债期货、债券远期、利率互换、外汇衍生品、定向、集合及信托等产品。其中，自营非权益类证券按照其市值计算；国债期货、债券远期投资规模分别按照合约名义价值总额的5%和50%计算；利率互换、外汇衍生品投资规模按照合约名义价值总额的3%计算。对于已有效对冲风险的投资组合，按投资规模总额的1%计算，投资规模为多头规模的绝对值与空头规模的绝对值之和。
 7. 因包销、中国证监会认可的做市业务以及股票质押违约处理等导致的情形及中国证监会另有认定的除外。
 8. 不含同业存单。因包销等导致的情形及中国证监会另有认定的除外。证券公司委托其他证券公司、基金公司、信托公司等机构进行的一对一投资不必填报。
 9. 融资（含融券）的金额指证券公司开展融资融券业务、约定式购回交易、股票质押式回购交易等融资类业务融出（含融券）金额总计。
 10. 单一客户融资（含融券）业务指客户参与融资融券业务、约定式购回交易、股票质押式回购交易等融资类业务。
 11. 指证券公司开展融资融券业务接受的担保股票。
 12. 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：



风险控制指标监管报表说明

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：王连志；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、风险控制指标监管报表及其报表说明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)、《证券期货经营机构参与股票期权交易试点指引》(中国证监会公告[2015]1 号)、《关于修改<证券公司风险控制指标管理办法>的决定》(中国证监会第 125 号令)、《证券公司风险控制指标计算标准规定》(中国证监会公告[2016]10 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）、《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）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 2016 年度财务报表及有关财务会计记录为基础而编制的。

根据《关于修改<证券公司风险控制指标管理办法>的决定》（中国证监会第 125 号令）相关规定，为充分反映和有效防范证券公司风险，根据市场发展情况，中国证监会制定了《证券公司风险控制指标计算标准规定》，自 2016 年 10 月 1 日执行。《关于调整证券公司净资本计算标准的规定》（证监会公告[2012]37 号）、《关于修改<证券公司风险资本准备计算标准的规定>的决定》（证监会公告[2012]36 号）同时废止。

本净资本计算表、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、风险控制指标监管报表已按照《关于修改<证券公司风险控制指标管理办法>的决定》（中国证监会第 125 号令）、《证券公司风险控制指标计算标准规定》（中国证监会公告[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）相关规定，对 2015 年 12 月 31 日相关数据进行重述。



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)

统一社会信用代码 91310101568093764U

证照编号 01000000201605190002

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67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



2016年05月19日

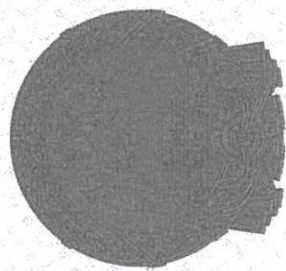
证书序号: NO. 017359

说明
此证复印件仅作为报告附件使用，
不能作为他用。

- 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》。



中华人民共和国财政部制



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61号四楼

组织形式:特殊普通合伙制

会计师事务所编号:31000006

注册资本(出资额):人民币10700万元整

批准设立文号:沪财会(2000)26号(转制批文 沪财会(2010)82号)

批准设立日期:2000年6月13日(转制日期 2010年12月31日)



此证复印件仅作为报告书附件使用，
不能作为他用。
证书号：000373

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：





此证复印件仅作为报告附件使用，
不能作为他用



中国注册会计师协会



姓名 许培楠
Full name
性别 女
Sex
出生日期 1975.8.2
Date of birth
工作单位 立信会计师事务所
Working unit
身份证号 37283375
Identity card No.

08.12



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

同意调出
Agree the holder to be transferred out



事务所
CPA

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

2012年12月11日

同意调入
Agree the holder to be transferred in



事务所
CPA

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

2012年12月11日

同意调出
Agree the holder to be transferred out



事务所
CPA

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

2012年12月20日

同意调入
Agree the holder to be transferred in



事务所
CPA

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

2012年12月20日

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 月 日

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 月 日

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 月 日

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 月 日



此证复印件仅作为报告附件使用，
不能作为他用。



姓名 孟红娜
Full name 孟红娜
性别 女
Sex 女
出生日期 1976-05-15
Date of birth 1976-05-15
工作单位 立信会计师事务所有限公司
Working unit 立信会计师事务所有限公司
身份证号码 110100690038
Identity card 110100690038



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

同意调出
Agree the holder to be transferred from

事务所
CPAs

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

同意调入
Agree the holder to be transferred to

事务所
CPAs

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

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

同意调出
Agree the holder to be transferred from

事务所
CPAs

转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs

同意调入
Agree the holder to be transferred to

事务所
CPAs

转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs

10

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，
This certificate is valid
this renewal.



年 月 日
Year Month Day

110100690038

北京注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

证书编号
No. of Certificate

发证日期
Date of Issuance

2010年5月25日
Year Month Day

4

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 月 日
Year Month Day

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格
This certificate is valid
this renewal.



年 月 日
Year Month Day

7