

证券金融公司净资本计算表

编制单位：中国证券金融股份有限公司

2012年9月30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	7,699,579,581.23	10,822,357,738.68		7,699,579,581.23	10,822,357,738.68
减：金融资产的风险调整合计	2	-	-		-	-
1、股票注1	3	-	-		-	-
其中：上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	4	-	-	10%	-	-
一般上市股票	5	-	-	15%	-	-
未上市流通的股票	6	-	-	20%	-	-
限制流通的股票	7	-	-	20%	-	-
持有一种股票的市值与该股票市值的比例超过5%的	8	-	-	40%	-	-
ST股票	9	-	-	50%	-	-
*ST股票	10	-	-	60%	-	-
已退市且在代办股份转让系统挂牌的股票	11	-	-	80%	-	-
已退市且未在代办股份转让系统挂牌的股票	12	-	-	100%	-	-
2、货币市场基金	13	-	-	1%	-	-
3、短期融资券	14	-	-		-	-
其中：有担保	15	-	-	3%	-	-
没有担保	16	-	-	6%	-	-
4、国债（包括政府债券）	17	-	-	1%	-	-
5、央行票据	18	-	-	1%	-	-

6、金融债券（包括国际开发机构人民币债券）	19	-	-	1%	-	-
7、证券投资基金（不含货币市场基金）	20	-	-	2%	-	-
8、可转换债券	21	-	-	5%	-	-
9、企业债券（包括公司债券、中期票据）	22	-	-		-	-
其中：有担保	23	-	-	5%	-	-
没有担保	24	-	-	10%	-	-
10、信托产品投资注2	25	-	-	80%	-	-
11、集合理财计划投资	26	-	-	10%	-	-
12、证券金融公司委托基金公司、证券公司进行的证券投资	27	-	-	10%	-	-
13、其他金融产品投资注3	28	-	-		-	-
减：衍生金融资产的风险调整合计	29	-	-		-	-
1、权证投资	30	-	-	20%	-	-
2、利率互换公允价值变动收益形成的资产	31	-	-	100%	-	-
3、其他衍生金融资产注4	32	-	-		-	-
减：其他资产项目的风险调整合计	33	6,652,409,978.43	7,180,158,122.05		353,508,864.51	381,851,204.46
1、拆出资金（合同期以内）	34	-	-	0%	-	-
2、融出资金注5	35	6,620,000,000.00	7,149,000,000.00	5%	331,000,000.00	357,450,000.00
3、融出证券注6	36	-	-	5%	-	-
4、买入返售金融资产（未逾期）	37	-	-	0%	-	-
5、应收利息	38	10,068,880.35	6,928,021.36	0%	-	-
6、存出保证金	39	250000	250,000.00		-	-
其中：交易保证金	40	250000	250,000.00	0%	-	-
履约保证金	41			10%		
期货保证金注7	42	-	-	100%	-	-
其他存出保证金	43	-	-		-	-

7、长期股权投资(不含对上市公司的股权投资)	44	-	-	100%	-	-
8、投资性房地产	45	-	-	100%	-	-
9、固定资产	46	4,261,046.41	4,369,873.09		4,261,046.41	4,369,873.09
其中：所有权权属明确的房产	47	-	-	100%	-	-
其他固定资产	48	4,261,046.41	4,369,873.09	100%	4,261,046.41	4,369,873.09
10、无形资产	49	2,841,827.84	2,807,672.35		2,458,494.51	2,427,672.35
其中：交易席位费	50	766,666.67	760,000.00	50%	383,333.34	380,000.00
其他无形资产	51	2,075,161.17	2,047,672.35	100%	2,075,161.17	2,047,672.35
11、商誉	52	-	-	100%	-	-
12、递延所得税资产	53	-	-	100%	-	-
13、应收股利	54	-	-	0%	-	-
14、应收融资融券客户款	55	-	-	100%	-	-
15、应收款项	56	8,010,997.69	8,011,037.69		801,099.77	801,103.77
其中：账龄一年以内（含一年）	57	8,010,997.69	8,011,037.69	10%	801,099.77	801,103.77
账龄一年至二年（含二年）	58	-	-	50%	-	-
账龄二年以上	59	-	-	100%	-	-
应收股东及其关联公司款项	60	-	-	100%	-	-
16、抵债资产	61	-	-	100%	-	-
17、长期待摊费用	62	2,530,773.95	2,484,518.34	100%	2,530,773.95	2,484,518.34
18、其他	63	12,457,449.88	14,318,036.91	100%	12,457,449.88	14,318,036.91
减：或有负债的风险调整合计	64	-	-		-	-
1、对外担保金额（公司为自身负债提供的反担保除外）	65	-	-	100%	-	-
2、其他或有负债注8	66	-	-		-	-
减：中国证监会认定的其他调整项目合计注12	67	-	-		-	-

1、所有权受限等无法变现的资产(如被冻结)	68	-	-	100%	-	-
2、其他项目	69	-	-		-	-
加：中国证监会核准的其他调整项目注9	70	-	-		-	-
1、借入的次级债务注10	71	-	-		-	-
2、母公司提供的担保承诺	72	-	-		-	-
净资本金额	73				7,346,070,716.72	10,440,506,534.22
附 1：期末或有事项						
附 2：其他需要特别说明的事项						

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。不包括借入的证券。

2、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%的比例进行风险调整。

3、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。有担保中小企业私募债券，按照 5%比例扣减净资本，无担保中小企业私募债券，按照 20%比例扣减净资本，并统一在“其他金融产品投资”一行中予以合并填列。

4、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。

5、包括自有资金及借入的资金。

6、不包括借入的证券。融出自营证券时，除按照融出证券市值的 5%扣减净资本外，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本。

7、期货保证金是指已被股指期货合约占用的交易保证金。

8、按或有事项涉及金额的 20%或可能发生的损失孰高者扣除。

9、指由中国证监会核准的其他允许计入净资本或从中扣除的项目。

10、次级债计入净资本的具体比例同《证券公司借入次级债务规定》（证监会公告[2010]23号）中规定。

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。

12、未上市流通或限制流通股票，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。

13、第 26 行的“集合理财计划投资”指公司投资证券公司设立的集合理财计划。证券金融公司委托基金公司、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），参照集合理财计划投资，按 10%比例扣减净资产。

法定代表人：



总经理：

财务负责人：

徐凤霞

制表人：

李明磊

办公电话：

办公电话：

办公电话：010-63211678

办公电话：010-63211704

移动电话：

移动电话：