

风险管理公司风险观测指标汇总表

填报机构：

年 月 日

单位：元

指标序号	指标名称	行次	上期数	本期数	变动比例	备注
一、	杠杆类指标	1				
	总资产	2				
	负债	3				
	净资产	4				
	核心净资本	5				
	附属净资本	6				
	净资本	7				
1	净资本/负债	8				
	流动资产	9				
	流动负债	10				
2	流动比率 =流动资产/流动负债	11				
3	净资产/负债	12				
4	资产负债率 =负债/总资产	13				
	或有负债	14				
5	资本杠杆率 =(核心净资本+或有负债)/总资产	15				
二、	财务类指标	16				
	净利润	17				
	净资产	18				
6	净资产收益率 =净利润/净资产	19				
	营业成本	20				
	期初存货	21				
	期末存货	22				
7	存货周转率 =营业成本*2/(期初存货+期末存货)	23				
	营业收入	24				
	期初应收账款	25				
	期末应收账款	26				
8	应收账款周转率 =营业收入*2/(期初应收账款+期末应收账款)	27				

	已使用银行授信	28				
	向关联方借款	29				
	票据质押	30				
	其他融资	31				
	净资产	32				
9	融资比率 = (已使用银行授信+向关联方借款 +票据质押+其他融资) /净资产	33				
	金融机构及关联方长期借款	34				
	其中：银行一年以上借款	35				
	非银金融机构一年以上借款	36				
	非金融机构的关联方一年以上借款	37				
三、	资金分配情况	38				
	期现业务资金分配量	39				
	场外业务资金分配量	40				
	做市业务资金分配量	41				
	其他类资金	42				
	资金总额	43				
10	期现业务资金占比 =期现业务资金分配量/资金总额	44				
11	场外业务资金占比 =场外业务资金分配量/资金总额	45				
12	做市业务资金占比 =做市业务资金分配量/资金总额	46				
13	其他资金占比 =其他类资金/资金总额	47				

说明：

- 1.财务报表中涉及科目，取财报中金额。财务报表合并口径为风险管理公司及其控股的从事风险管理业务的境内子公司，不包括其他境内子公司、所有境外子公司。
- 2.净资本计算表中涉及项目，口径和金额需与净资本报表一致。
- 3.行次 17 和 19，净利润按照年初至填报当月的累计利润计算。
- 4.行次 20 和 24，营业成本、营业收入为报送当月发生的。
- 5.行次 21 和 25，期初存货、期初应收账款均为月初数。
- 6.行次 23 和 27，如没有存货则无需计算存货周转率，没有应收账款则无需计算应收账款周转率。
- 7.行次 31 其他融资，包括仓单质押、仓单充抵场内外保证金等其他形式的融资。
- 8.行次 38，资金分配情况，指公司分配给此项业务的可使用资金总额，包括存续交易占用资金和暂未使用资金。
- 9.行次 42 其他类资金，指未分配给期现业务、场外业务、做市业务使用的其他资金，包括其他业务以及财务投资占用资金等。