

长城证券股份有限公司

2020 年上半年风险控制指标报告

2020 年上半年，长城证券股份有限公司（以下简称公司）严格落实《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司全面风险管理规范》等法规及自律规则要求，动态监控净资本和流动性指标等风险控制指标，认真开展敏感性分析和压力测试工作，确保净资本和流动性指标等各项风险控制指标持续符合规定标准。

一、报告期内风险控制指标的具体情况和达标情况

（一）报告期内，公司风险控制指标具体情况：

单位：万元

项 目	2020 年 6 月 30 日 (未经审计)	2019 年 12 月 31 日 (经审计)	预警标准	监管标准
核心净资本	1,287,451.31	1,277,838.66		
附属净资本	170,000.00	-		
净资本	1,457,451.31	1,277,838.66		
净资产	1,708,140.29	1,675,554.33		
各项风险资本准备之和	823,196.92	688,389.23		
表内外资产总额	5,529,438.78	4,471,025.15		
风险覆盖率	177.05%	185.63%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	23.29%	28.63%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	169.73%	330.91%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	150.76%	133.71%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	85.32%	76.26%	≥24%	≥20%
净资本/负债	39.96%	47.68%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	46.84%	62.51%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	9.72%	10.96%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	196.38%	181.67%	≤400%	≤500%

备注：根据《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告[2020]10号）的要求，2020 年 6 月 30 日起，风险控制指标监管报表按照新修订格式报送。

（二）公司风险控制指标达标情况

报告期内，本公司以净资本和流动性指标为核心的各项风险控制指标持续符合监管标准，没有发生触及监管标准的情况。

二、报告期内风险控制指标动态监控情况

根据《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》《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》《证券公司流动性风险管理指引》等规定，公司制定了《风险控制指标管理办法》《流动性风险管理办法》《风险控制指标动态监控系统管理办法》，建立了风险控制指标动态监控系统，实现对净资本和流动性指标等各项风险控制指标的动态监控和自动预警，确保业务开展过程中各项指标持续满足监管标准，并按照规定开展敏感性分析和压力测试工作，根据监控情况及压力测试结果及时采取有效措施，确保净资本和流动性指标等各项风险控制指标持续符合规定标准。公司按要求每月由专人编制并按时向证监会派出机构报送月度风险控制指标监管报表。

三、净资本补足机制建立情况

公司建立并持续完善了净资本补足机制，当净资本和流动性指标等风险控制指标接近监管预警标准时，将立即启动内部应急机制，采取措施补足净资本或优化业务结构化解风险。

报告期内，公司成功发行 20 亿元次级债，有效补充公司净资本。

长城证券股份有限公司董事会

2020 年 8 月 24 日