

长江证券股份有限公司

2021 年半年度风险控制指标报告

2021 年上半年，长江证券股份有限公司（以下简称公司）严格贯彻落实《证券公司全面风险管理规范》、《证券公司风险控制指标管理办法》等制度要求，动态监控净资本和流动性等风险控制指标，持续健全压力测试体系，开展各项专项和综合压力测试，确保风险控制指标持续符合监管标准。

一、报告期内公司风险控制指标的具体情况和达标情况

| 项目 | 2020年12月31日 (经审计) | 2021年6月30日 (未审计) | 预警标准 | 监管标准 |
|-------------------|----------------------|---------------------|-------|-------|
| 核心净资本(亿元) | 201.59 | 197.91 | | |
| 附属净资本(亿元) | 15.00 | 21.00 | | |
| 净资本(亿元) | 216.59 | 218.91 | | |
| 净资产(亿元) | 281.18 | 285.14 | | |
| 各项风险资本准备之和(亿元) | 107.72 | 124.28 | | |
| 表内外资产总额(亿元) | 989.71 | 1116.28 | | |
| 风险覆盖率 | 201.07% | 176.14% | ≥120% | ≥100% |
| 资本杠杆率 | 20.38% | 18.37% | ≥9.6% | ≥8% |
| 流动性覆盖率 | 186.45% | 134.41% | ≥120% | ≥100% |
| 净稳定资金率 | 149.32% | 135.26% | ≥120% | ≥100% |
| 净资本/净资产 | 77.03% | 76.77% | ≥24% | ≥20% |
| 净资本/负债 | 30.86% | 26.80% | ≥9.6% | ≥8% |
| 净资产/负债 | 40.06% | 34.91% | ≥12% | ≥10% |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本 | 24.96% | 15.68% | ≤80% | ≤100% |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本 | 206.71% | 271.89% | ≤400% | ≤500% |
| 融资(含融券)的金额/净资本 | 153.12% | 155.16% | ≤320% | ≤400% |

报告期内，公司净资本等主要风险控制指标均持续符合监管标准。

二、风险控制指标动态监控情况

(一) 指标动态监控机制

公司严格执行监管机构的相关要求，建立了净资本和流动性指标

动态监控系统，辅以相关业务管理系统，设置了内部预警标准对风险控制指标实施动态监控。风险管理部、财务总部及相关业务部门设立专人专岗，相互配合，动态监控风险控制指标的变动情况，并按照监管规定，当指标出现异常情形时，及时向监管机构进行报告。总体而言，通过建立事前评估、事中监控、事后分析的风险控制指标动态监控机制，公司能够全面监控各项风险控制指标的变动情况，及时预警并采取有效措施，确保各项风险控制指标持续满足监管要求。

（二）指标动态监控情况

报告期内，净资本及流动性等主要风险控制指标持续满足监管要求。集中度指标方面，出现过因客户赎回导致被动触及预警的情况，根据《证券公司风险控制指标监管报表》附注说明，因其他投资者赎回、减资导致投资标的总规模缩小等原因造成指标出现被动超标情形的，可不认定为违规情形，且公司均已按照监管要求及时向监管机构进行报告。

三、报告期内风险控制指标压力测试情况

2021 年上半年，公司在对经济形势、市场环境进行综合评估的基础上，结合公司资产负债结构和业务发展策略，实施了 1 次综合压力测试；专项压力测试方面，公司开展了年度风险偏好授权、债券承销、分红和子公司注资、流动性风险等各类专项压力测试。测试结果显示，公司风险控制指标具有足够的承压能力，在轻、中、重三类压力情景下，公司主要风险控制指标均符合监管标准。

四、净资本补足机制

公司建立了净资本补足触发机制，在达到资本补足触发条件时，公司将启动资本补足计划，计划包括：（1）优先考虑优化资产结构，限制资本占用程度高的业务发展；（2）加强风险资产管理，采用风险缓释措施；（3）制定外部资本补充工具的类型、发行规模、发行市场、投资者群体、定价机制以及相关政策问题的解决方案等；已发行资本工具附有减记或转股条款的，根据约定或监管规定进行减记或转股；（4）提高公司自身盈利能力，同时调整资本补充期间分红政策。

报告期内，公司成功发行次级债券 30 亿元，有效补充了公司净资本，进一步增强了公司主要风险控制指标的承压能力。

长江证券股份有限公司董事会

二〇二一年八月二十八日