

华林证券股份有限公司

2021 年度风险控制指标情况报告

2021 年，华林证券股份有限公司（以下简称“公司”）根据《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》等规范要求，持续加强全面风险管理体系建设，严格按照监管要求落实风险控制指标动态监控和管理工作，不断健全压力测试体系，开展综合压力测试及各类专项压力测试，确保风险控制指标持续符合监管标准。

一、公司主要风险控制指标情况

单位：元

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	监管基准	预警标准
核心净资本	4,672,089,972.47	4,724,551,156.13	\	\
附属净资本	0.00	0.00	\	\
净资本	4,672,089,972.47	4,724,551,156.13	\	\
净资产	5,980,077,704.45	5,858,081,390.08	\	\
各项风险资本准备之和	1,193,975,256.15	1,585,080,884.14	\	\
表内外资产总额	12,436,473,945.31	18,224,595,412.77	\	\
风险覆盖率	391.31%	298.06%	≥100.00%	≥120.00%
资本杠杆率	37.57%	25.92%	≥8.00%	≥9.60%
流动性覆盖率	181.07%	257.86%	≥100.00%	≥120.00%
净稳定资金率	176.69%	206.14%	≥100.00%	≥120.00%
净资本/净资产	78.13%	80.65%	≥20.00%	≥24.00%
净资本/负债	84.81%	41.16%	≥8.00%	≥9.60%
净资产/负债	108.55%	51.03%	≥10.00%	≥12.00%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	13.62%	13.11%	≤100.00%	≤80.00%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	79.76%	221.30%	≤500.00%	≤400.00%

二、动态风险控制指标监控情况

公司建立了风险控制指标动态监控体系，制定了《华林证券股份有限公司风险控制指标和动态监控系统管理办法》、《华林证券股份有限公司压力测试管理办法》等制度，明确了风险控制指标管理及压力测试等工作要求。

公司按照监管法规的规定计算净资本、风险覆盖率、资本杠杆率、流动性覆

盖率、净稳定资金率等各项风险控制指标，编制净资本计算表、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和风险控制指标计算表。公司建立了风险控制指标动态监控系统，风险管理部及计划财务部每日通过风险控制指标动态监控系统，对公司净资本等各项风险控制指标的前一日动态情况进行监控、审核及报告。公司根据自身资产负债状况和业务发展情况，建立了净资本补足机制，确保净资本等各项风险控制指标符合规定标准。

三、风险控制指标压力测试情况

为促进公司提升风险管理能力，公司按照《关于报送证券公司2021年度综合压力测试报告的通知》（中证协发[2021]73号）、《证券公司压力测试指引（修订稿）》（中证协发[2016]251号）等相关要求，由公司领导牵头，组织风险管理部、计划财务部、运营部等相关职能部门和各业务部门，于2021年4月开展了2021年度综合压力测试工作，评估未来压力情景下公司整体风险状况及风险承受能力。测试结果显示，在轻度、中度和重度三种压力情景下，公司未出现风控指标不达标或者净资本不足的情况。

2021年，在公司发生业务调整等重大经营变化时，均开展了风险控制指标专项压力测试，综合分析测试结果并提出相关管理建议，以确保公司的各项风险控制指标持续符合监管要求。

华林证券股份有限公司董事会

二〇二二年三月二十六日