

# 长江证券股份有限公司

## 2021 年度风险控制指标报告

2021 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》等各项监管制度要求，持续动态监控净资本和流动性等风险控制指标，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12月31日 (经审计)	预警标准	监管标准
核心净资本(亿元)	201.59	195.00		
附属净资本(亿元)	15.00	35.00		
净资本(亿元)	216.59	230.00		
净资产(亿元)	281.18	292.21		
各项风险资本准备之和(亿元)	107.72	112.34		
表内外资产总额(亿元)	989.71	1156.48		
风险覆盖率	201.07%	204.73%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	20.38%	17.47%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	186.45%	165.57%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	149.32%	156.38%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	77.03%	78.71%	≥24%	≥20%
净资本/负债	30.86%	27.13%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	40.06%	34.46%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	24.96%	17.99%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	206.71%	254.13%	≤400%	≤500%
融资(含融券)的金额/净资本	153.12%	157.58%	≤320%	≤400%

报告期内，母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，在中国证监会规定的风险控制指标监管标准和预警标准的基础上，设置了更为严格的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，说明基本情况、问题成因以及解决问题的具体措施和期限。总体而言，公司建立的风险控制指标动态监控机制，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，监控机制和报告程序均符合监管规定，未发生违规情形。

## 三、报告期内风险控制指标压力测试情况

2021年，公司通过对经济形势、市场环境进行综合评估，结合公司资产负债结构、业务发展策略，设定了不同程度的压力情景，共实施了3次综合压力测试；专项压力测试方面，公司开展了市场风险、信用风险、流动性风险、年度授权、债券承销、分红和子公司担保等各类专项压力测试。上述测试结果显示，公司风险控制指标承压能力

较强，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

公司根据中国证券业协会发布的《证券公司资本补充指引》，建立了动态的净资本补足机制，持续拓展资本补充渠道，确保公司净资本与业务发展需要相匹配：（1）优化资产结构，适时调节风险性较高的资产品种和规模；（2）综合评估补充资本的必要性、可行性，制定外部资本补充方案，包括资本补充工具的类型、发行规模、发行市场、投资者群体、定价机制等；（3）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 50 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

二〇二二年四月三十日