

长江证券股份有限公司

2026 年半年度风险控制指标报告

2026 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》《证券公司全面风险管理规范》等各项监管要求，动态监控净资本等风险控制指标，及时开展压力测试和资本补充，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情况

项 目	2025年12月31日 (经审计)	2026年6月30日 (未经审计)	预警标准	监管标准
核心净资本（亿元）	206.31	209.54		
附属净资本（亿元）	56.00	69.00		
净资本（亿元）	262.31	278.54		
净资产（亿元）	385.55	386.45		
各项风险资本准备之和（亿元）	63.58	69.75		
表内外资产总额（亿元）	1,194.60	1,139.36		
风险覆盖率	412.53%	399.37%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	17.77%	18.40%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	211.34%	288.48%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	177.76%	178.36%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	68.03%	72.08%	≥24%	≥20%
净资本/负债	28.34%	32.17%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	41.66%	44.63%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	6.65%	12.53%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	225.97%	138.16%	≤400%	≤500%
融资（含融券）的金额/净资本	176.23%	193.06%	≤320%	≤400%

公司动态监控各项风险控制指标情况。报告期内，公司净资本等各项风险控制指标均持续符合监管标准，监控机制和报告程序均符合

监管规定，未发生违规情形。

二、压力测试情况

2026 年上半年，公司根据监管要求，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，开展了年度综合压力测试及多项专项压力测试。测试结果显示，公司风险控制指标承压能力较强，能够抵御各类压力情景下的冲击。

三、净资本补足情况

公司根据监管要求建立了净资本补足机制，及时根据公司经营情况调整优化资产负债结构，并通过各类工具进行资本补充，确保公司净资本与业务发展需要相匹配。

报告期内，公司成功发行次级债券 25 亿元，有效补充了净资本，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

二〇二六年八月二十六日