

华西证券股份有限公司

2020 年上半年度风险控制指标情况报告

2020 年上半年，华西证券股份有限公司（以下简称“公司”）持续加强全面风险管理体系建设，从制度体系、组织架构、信息系统、指标体系、人员配备、应对机制等六个方面不断建立健全公司全面风险管理体系。公司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，及时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、报告期内公司主要风险控制指标情况

单位：元

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 6 月 30 日	预警标准	监管标准
核心净资本	16,018,237,940.08	16,629,421,548.55		
附属净资本	550,000,000.00	700,000,000.00		
净资本	16,568,237,940.08	17,329,421,548.55		
净资产	19,369,138,973.68	19,964,868,166.30		
各项风险资本准备之和	4,750,448,707.15	5,477,885,072.20		
表内外资产总额	51,355,339,245.76	61,485,256,232.75		
风险覆盖率	348.77%	316.35%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	31.29%	27.07%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	247.92%	263.20%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	146.10%	195.16%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	85.54%	86.80%	≥24%	≥20%
净资本/负债	53.74%	43.31%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	62.82%	49.89%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	14.58%	11.26%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	147.11%	201.65%	≤400%	≤500%

报告期内，公司以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标均

持续符合监管标准。

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《风险控制指标管理办法》、《风险限额管理办法》、《压力测试管理办法》等制度，明确了风险控制指标监控及压力测试等工作要求。

公司风险控制指标的动态风险管理流程包括风险识别、评估、监测、控制与报告。公司建立了风险控制指标动态监控技术系统，指定专人对净资产等风险控制指标进行日常监控与报告。公司根据自身资产负债状况和业务发展情况，建立了净资产补足机制，确保净资产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

2020 年上半年，公司根据中国证券业协会下发的《关于报送证券公司 2020 年度综合压力测试报告的通知》，组织开展了 2020 年年度综合压力测试。测试结果显示，公司在轻、中、重度压力情景各项风险控制指标均未触及监管标准。

公司在开展证券承销、股利分配、设立子公司或增资子公司等重大业务或经营行为时，均开展了风险控制指标压力测试，在测算分析基础上提出经营管理建议，确保公司的各项风险控制指标符合监管要求。

华西证券股份有限公司

2020 年 8 月 13 日