

国元证券股份有限公司

2020年半年度风险控制指标报告

2020年上半年,国元证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)切实贯彻监管要求,动态监控净资本、流动性等风险控制指标,全面开展净资本和流动性敏感性分析和压力测试,确保风险控制指标持续达到监管部门规定的标准。

一、报告期内风险控制指标的具体情况和达标情况

(一) 报告期内,本公司风险控制指标具体情况

单位:元

项 目	2020年6月30日	2019年12月31日	预警标准
核心净资本	14,222,095,400.00	14,442,371,464.68	
附属净资本	1,469,886,212.11	1,469,860,025.66	
净资本	15,691,981,612.11	15,912,231,490.34	
净资产	23,626,377,572.91	23,375,424,759.94	
各项风险资本准备之和	5,141,595,744.07	5,311,071,953.98	
表内外资产总额	57,783,332,395.86	55,550,701,808.88	
风险覆盖率(%)	305.20%	299.60%	≥120.00%
资本杠杆率(%)	25.90%	26.90%	≥9.60%
流动性覆盖率(%)	324.57%	233.59%	≥120.00%
净稳定资金率(%)	139.01%	137.04%	≥120.00%
净资本/净资产(%)	66.42%	68.07%	≥24.00%
净资本/负债(%)	47.70%	50.82%	≥9.60%
净资产/负债(%)	71.83%	74.66%	≥12.00%
自营权益类证券及其衍	11.12%	4.59%	≤80.00%

衍生品/净资本 (%)			
自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	166.45%	162.93%	≤400.00%

注：公司2019年6月30日以净资本及流动性为核心的各项风险控制指标根据《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第125号）《证券公司风险控制指标计算标准规定》（2020年第10号公告）和《证券公司风险控制指标监管报表填报口径》进行填列，并依照此填报口径对2019年末的数据进行调整，调整后数据未进行审计。

（二）报告期内，本公司风险控制指标达标情况

报告期内，本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，没有发生触及监管标准的情况。

二、报告期内风险控制指标动态监控情况

根据《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》《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》的要求，公司风险监管部、财务会计部、资金计划部相互配合，设立专人专岗，对净资本、流动性等风险控制指标进行动态监控，及时掌握风险控制指标的变动情况。每月末，公司按照监管要求及时上报月度净资本计算表、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监管报表。当出现净资本、流动性等风险控制指标与上月相比发生不利变化超过20%的情形时，公司在该情形发生之日起3个工作日内，及时向监管机构上报书面报告，说明基

本情况和变化原因。本公司风险控制指标动态监控机制，能够及时监控以净资本、流动性为核心的各项风险控制指标的变动情况，并根据变化情况采取有效措施，以确保各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。

三、报告期内风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

（一）净资本敏感性分析和压力测试情况

报告期内，本公司针对财务预算草案、IPO 及债券承销项目、申购债券、报价回购业务、增资子公司等事项，采用情景分析压力测试方法，测试多种风险因素同时变化的压力情景下公司风险控制指标的达标情况，上半年共提交 34 次专项压力测试报告。

根据中国证券业协会的统一要求，报告期内本公司共开展 1 次综合压力测试。依据统一情景压力测试方案，结合自身业务特点，以基期数据为基准，在充分预计整体风险的基础上，审慎、合理设定相关压力情景，对相关时点的业务开展、财务状况及净资本等风险控制指标进行综合压力测试，评估未来压力情景下公司整体风险状况及风险承受能力。

（二）流动性敏感性分析和压力测试情况

报告期内，公司根据《证券公司流动性风险管理指引》（2016 年修订）的要求，针对重要的业务操作和经营行为进行 48 次专项压力测试，并按照协会要求，对公司整体流动性状况进行了 1 次年度综合压力测试、2 次季度综合压力测试。公司严格按照协会流动性压力测试的规定，根据市场状况、公司业务和经营的实际

情况，审慎、合理的设定压力测试情景，全面的测试相关业务和经营行为对公司流动性风险监管指标和公司整体流动性状况的影响。相关测试对流动性风险的事前防范、公司业务和经营决策对发挥了积极的作用，公司流动性风险压力测试工作整体有效。

四、净资本补足机制建立情况

本公司建立了净资本补足机制，在董事会制定并通过实施的《国元证券财务管理制度》《国元证券风险控制指标管理办法》中规定，当公司净资本等各项风险控制指标达到预警标准时，公司将采用压缩风险性较高的投资经营品种或规模、追讨往来账项、转让长期股权投资、处置有形或无形资产、加大提取任意盈余公积、减少或暂停利润分配、发行次级债或债转股、募集资本金等方式补充净资本，以确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管部门的要求。

国元证券股份有限公司董事会

2020年8月13日