

证券代码：832970

证券简称：东海证券

主办券商：东吴证券

东海证券股份有限公司

2018 年上半年风险控制指标报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司按照证券公司风险控制指标相关法规要求，结合实际情况，深入开展压力测试，合理分配各业务规模和风险指标限额；动态监控风险控制指标，及时评估业务风险，调整规模限额指标，2018 年上半年，公司风险控制指标管理工作有效，风控指标持续达标。

一、风险控制指标达标情况

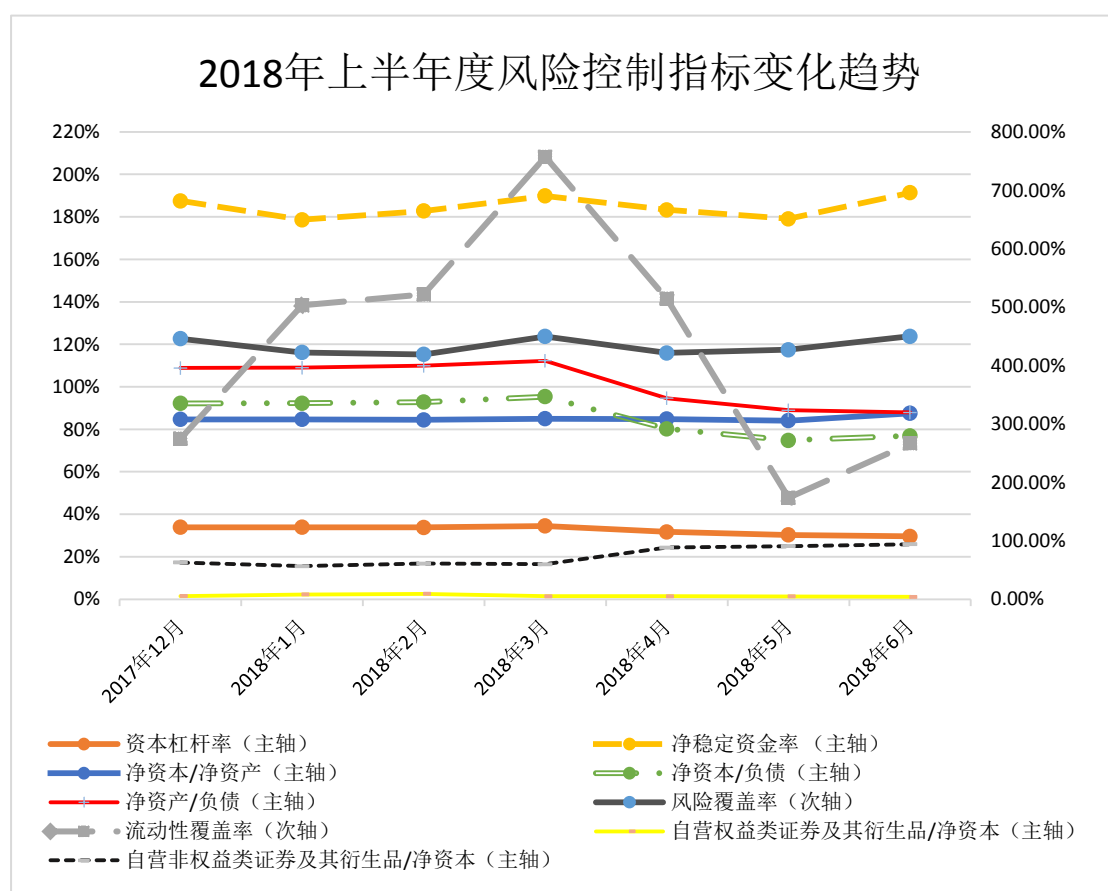
报告期内，公司净资本及流动性等主要风险控制指标没有发生触及预警标准及不符合监管标准的情形，风控指标持续达标，主要风控指标情况如下表：

项 目	2017 年 12 月 (经审计)	2018 年 6 月	预警 标准	监管 标准
核心净资本（元）	5,628,047,956.82	5,310,232,898.21		
附属净资本（元）	1,500,000,000.00	1,875,000,000.00		
净资本（元）	7,128,047,956.82	7,185,232,898.21		
净资产（元）	8,417,639,444.55	8,239,139,905.60		
各项风险资本准备之和（元）	1,598,614,226.83	1,607,932,345.33		
表内外资产总额（元）	16,623,367,311.86	18,167,377,101.61		
风险覆盖率	445.89%	446.86%	≥120%	≥100%
资本杠杆率	33.86%	29.23%	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	274.99%	266.11%	≥120%	≥100%
净稳定资金率	187.55%	190.89%	≥120%	≥100%
净资本/净资产	84.68%	87.21%	≥24%	≥20%
净资本/负债	92.18%	76.11%	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	108.86%	87.28%	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	5.34%	3.98%	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	62.95%	94.92%	≤400%	≤500%

二、风险控制指标动态监控情况

公司建立了风险控制指标动态监控机制，主要是通过风险控制指标动态监控

系统对风险控制指标准确计量、动态监控和及时预警，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。每月初，公司按照监管要求及时报送月度净资本计算表、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计算表。当出现净资本、流动性等风险控制指标与上月相比发生变化超过 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。报告期内的主要风险控制指标变化趋势图如下：

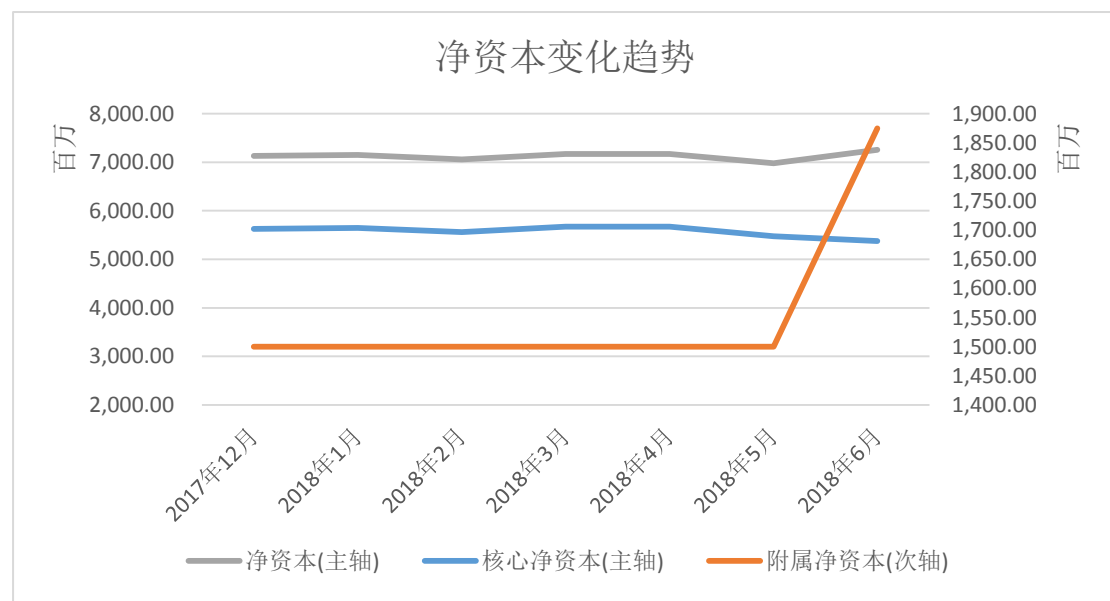


三、风险控制指标压力测试情况

公司建立了全面压力测试工作机制，形成了包括净资本风控指标压力测试、流动性指标压力测试、综合压力测试和专项压力测试在内的压力测试体系。报告期内，公司进一步梳理各类风险因子、更新完善风险压力测试参数，共实施综合及专项压力测试 12 次，主要内容和事项包括：2018 年上半年度综合压力测试，确定年度各业务规模和风险限额；专项压力测试，根据业务开展情况，评估业务风险损益和指标情况。压力测试机制的有效实施为公司经营决策提供了参考作用。

四、净资本补足和流动性管理机制

报告期内，公司净资产满足公司业务发展的需要，未发行股份补充资本，也未向股东或机构投资者借入或发行次级债。公司净资产规模一直维持在 82 亿元至 84 亿元之间，净资产规模在 1-4 月保持在 71 亿元左右，5 月份受证券市场价格波动影响下降为 69.8 亿元，而在 6 月份上升为 71.9 亿元主要是因为 2015 年 6 月发行了 10 亿元 3+2 次级债“15 东海债”，在 2018 年 6 月持有人行使回售选择权，回售 2.5 亿元，按照监管规定，将债券余额 7.5 亿元按 50%比例计入附属净资产，即净资产增加 3.75 亿元。报告期内，净资产变化趋势图如下：



公司加强流动性管理，积极拓展融资渠道，及时补充流动资金，提高资金实力。通过增加授信、收益权转让、发行收益凭证和同业拆借等方式及时融入资金。公司计划财务部持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备和可供随时变现的有价证券，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求，防范公司流动性风险。

东海证券股份有限公司

董事会

2018年8月31日